



Формулы Примеры с единицами

Список 14 Важный Форекс-менеджмент Формулы

1) Внутренняя ценность Формула ↻

Формула

$$ITV = SP - BSV$$

Пример

$$1.6 = 1.85 - 0.25$$

Оценить формулу ↻

2) Выплата для покупателя звонка Формула ↻

Формула

$$PCB = \max(0, S_T - X)$$

Пример

$$3 = \max(0, 29 - 26)$$

Оценить формулу ↻

3) Кумулятивное распределение два Формула ↻

Формула

$$D_2 = D_1 - v_{us} \cdot \sqrt{t_s}$$

Пример

$$57.5 = 350 - 195 \cdot \sqrt{2.25}$$

Оценить формулу ↻

4) Кумулятивное распределение одно Формула ↻

Формула

$$D_1 = \frac{\ln\left(\frac{P_c}{K}\right) + \left(R_f + \frac{v_{us}^2}{2}\right) \cdot t_s}{v_{us} \cdot \sqrt{t_s}}$$

Пример

$$146.2577 = \frac{\ln\left(\frac{440}{90}\right) + \left(0.30 + \frac{195^2}{2}\right) \cdot 2.25}{195 \cdot \sqrt{2.25}}$$

Оценить формулу ↻

5) Модель роста Гордона Формула ↻

Формула

$$P_c = \frac{D}{RR - g}$$

Пример

$$440 = \frac{22}{0.08 - 0.03}$$

Оценить формулу ↻

6) Модель ценообразования опциона Блэка-Шоулза-Мертон для опциона колл Формула ↻

Формула

$$C = P_c \cdot P_{\text{normal}}(D_1) - (K \cdot \exp(-R_f \cdot t_s)) \cdot P_{\text{normal}}(D_2)$$

Оценить формулу ↻

Пример

$$7568.2558 = 440 \cdot 0.05 \cdot (350) - (90 \cdot \exp(-0.30 \cdot 2.25)) \cdot 0.05 \cdot (57.5)$$



7) Модель ценообразования опциона Блэка-Шоулза-Мертона для опциона пут Формула



Формула

Оценить формулу

$$P = K \cdot \exp(-R_f \cdot t_s) \cdot (-D_2) - P_c \cdot (-D_1)$$

Пример

$$151365.1155 = 90 \cdot \exp(-0.30 \cdot 2.25) \cdot (-57.5) - 440 \cdot (-350)$$

8) Паритет процентных ставок Формула

Формула

Пример

Оценить формулу

$$k_f = S_p \cdot \left(\frac{1 + I_Q}{1 + I_B} \right)$$

$$27.2519 = 21 \cdot \left(\frac{1 + 16}{1 + 12.1} \right)$$

9) Прибыль для покупателя звонка Формула

Формула

Пример

Оценить формулу

$$Pft = \max(0, S_T - X) - c_0$$

$$1.5 = \max(0, 29 - 26) - 1.5$$

10) Процентная ставка Васичека Формула

Формула

Пример

Оценить формулу

$$dr_t = a \cdot (b - r_t) \cdot d \cdot t + \sigma \cdot d \cdot W_t$$

$$3675 = 12 \cdot (6 - 5) \cdot 50 \cdot 2 + 9 \cdot 50 \cdot 5.5$$

11) Размер позиции на Форексе Формула

Формула

Пример

Оценить формулу

$$Pf = \frac{A_E \cdot R_{f\%}}{S_{LP} \cdot P_{VF}}$$

$$1200 = \frac{45 \cdot 4}{15 \cdot 0.01}$$

12) Теория паритета покупательной способности с использованием инфляции Формула



Формула

Пример

Оценить формулу

$$E_f = \left(\frac{1 + I_h}{1 + I_f} \right) - 1$$

$$0.0373 = \left(\frac{1 + 0.39}{1 + 0.34} \right) - 1$$

13) Трехфакторная модель Фамы-Френча Формула

Формула

Оценить формулу

$$R_{exc} = \alpha_i + \beta_F \cdot (R_{mkt} - R_f) + (\beta_i \cdot SMB + \beta_{ml} + E_i)$$

Пример

$$23.134 = 8 + 0.07 \cdot (6.5 - 0.30) + (2.5 \cdot 3.5 + 4.5 + 1.45)$$



14) Форвардный курс Формула

Формула

$$F_o = Sp \cdot \ln \left((r_d - r_f) \cdot T \right)$$

Пример

$$40.8641 = 21 \cdot \ln \left((0.90 - 0.20) \cdot 10 \right)$$

Оценить формулу 



Переменные, используемые в списке Форекс-менеджмент Формулы выше

- **a** Скорость изменения среднего значения
- **A_E** Средства на счете
- **b** Долгосрочное среднее значение
- **BSV** Базовая стоимость
- **C** Теоретическая цена опциона колл
- **c₀** Звонок Премиум
- **d** Производные
- **D** Дивиденд на акцию
- **D₁** Кумулятивное распределение 1
- **D₂** Кумулятивное распределение 2
- **dr_t** Производная от короткой ставки
- **E_f** Фактор обменного курса
- **E_i** Срок ошибки
- **F_o** Форвардный курс
- **g** Постоянный темп роста дивидендов
- **h_{ml}** Чувствительность актива к HML
- **I_B** Процентная ставка базовой валюты
- **I_Q** Процентная ставка котируемой валюты
- **ITV** Внутренняя ценность
- **K** Цена исполнения опциона
- **k_f** Константа форвардного курса
- **P** Теоретическая цена опциона пут
- **P_c** Текущая цена акций
- **P_{normal}** Нормальное распределение
- **PCB** Выплата для покупателя звонка
- **Pf** Размер позиции на Форексе
- **Pft** Прибыль для покупателя звонка
- **r_d** Внутренняя процентная ставка
- **R_{f%}** Процент риска на Форексе
- **r_f** Иностранная процентная ставка
- **R_f** Безрисковая ставка

Константы, функции и измерения, используемые в списке Форекс-менеджмент Формулы выше

- **Функции: exp, exp(Number)**
В показательной функции значение функции изменяется на постоянный коэффициент при каждом изменении единицы независимой переменной.
- **Функции: ln, ln(Number)**
Натуральный логарифм, также известный как логарифм по основанию e, является обратной функцией натуральной показательной функции.
- **Функции: max, max(a1, ..., an)**
Максимум функции — это наибольшее значение, которое функция может вывести для любого возможного входа.
- **Функции: sqrt, sqrt(Number)**
Функция извлечения квадратного корня — это функция, которая принимает на вход неотрицательное число и возвращает квадратный корень из заданного входного числа.



- R_{mkt} Рыночный портфель
- r_t Короткая ставка
- R_{ex} Избыточная рентабельность активов
- RR Требуемая норма доходности
- S_{LP} Стоп-лосс в пипсах
- S_T Цена базового актива на момент истечения срока действия
- si Чувствительность актива к малому и среднему бизнесу
- SMB Маленький минус большой
- Sp Спотовый обменный курс
- SP Цена акции
- t Временной период
- T Время взросления
- t_s Время до истечения срока действия запаса
- v_{us} Волатильные базовые акции
- W_t Случайный рыночный риск
- X Цена исполнения
- α_i Альфа для конкретного актива
- β_F Бета на Форексе
- I_f Инфляция в зарубежной стране
- I_h Инфляция в родной стране
- P_{VF} Стоимость пункта на Форексе
- σ Волатильность во времени



Загрузите другие PDF-файлы Важный инвестиции

- **Важный Доходность облигаций**
Формулы 
- **Важный Форекс-менеджмент**
Формулы 

Попробуйте наши уникальные визуальные калькуляторы

-  процент уменьшение 
-  НОД трех чисел 
-  Умножить дробь 

Пожалуйста, **ПОДЕЛИТЕСЬ** этим PDF-файлом с теми, кому он нужен!

Этот PDF-файл можно скачать на этих языках

[English](#) [Spanish](#) [French](#) [German](#) [Russian](#) [Italian](#) [Portuguese](#) [Polish](#) [Dutch](#)

7/9/2024 | 6:18:39 AM UTC

