



calculatoratoz.com



unitsconverters.com

Форекс-менеджмент Формулы

Калькуляторы!

Примеры!

Преобразования!

Закладка calculatoratoz.com, unitsconverters.com

Самый широкий охват калькуляторов и рост - **30 000+ калькуляторов!**

Расчет с разными единицами измерения для каждой переменной -

Встроенное преобразование единиц измерения!

Самая широкая коллекция измерений и единиц измерения - **250+ измерений!**



Не стесняйтесь ПОДЕЛИТЬСЯ этим документом с друзьями!

[Пожалуйста, оставьте свой отзыв здесь...](#)



Список 14 Форекс-менеджмент Формулы

Форекс-менеджмент

1) Внутренняя ценность

$$fx \quad ITV = SP - BSV$$

[Открыть калькулятор !\[\]\(cbe2492b119e39e02a1dab2af4a4b296_img.jpg\)](#)

$$ex \quad 1.6 = 1.85 - 0.25$$

2) Выплата для покупателя звонка

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

[Открыть калькулятор !\[\]\(870f5d5e9c0d57485634be3ecf52f3ca_img.jpg\)](#)

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

3) Кумулятивное распределение два

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

[Открыть калькулятор !\[\]\(7d1d6890825e83a6a4a51febe2dcc7f3_img.jpg\)](#)

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



4) Кумулятивное распределение одно

fx

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

[Открыть калькулятор !\[\]\(23d9fc146e83b5c3013cfa32c784f8d5_img.jpg\)](#)

ex

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

5) Модель роста Гордона

fx

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

[Открыть калькулятор !\[\]\(758ebdf4629c903da74c2e079717ae32_img.jpg\)](#)

ex

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

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

fx

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

[Открыть калькулятор !\[\]\(c1168d6a8b365d11e842ece304635fa7_img.jpg\)](#)

ex

$$7568.256 = 440 \cdot 0.05 \cdot (350) - (90 \cdot \exp(-0.30 \cdot 2.25)) \cdot 0.05 \cdot (57.5)$$



7) Модель ценообразования опциона Блэка-Шоулза-Мертон для опциона пут

fxОткрыть калькулятор 

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

ex

$$151365.1 = 90 \cdot \exp(-0.30 \cdot 2.25) \cdot (-57.5) - 440 \cdot (-350)$$

8) Паритет процентных ставок

fxОткрыть калькулятор 

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

ex

$$27.25191 = 21 \cdot \left(\frac{1 + 16}{1 + 12.1} \right)$$

9) Прибыль для покупателя звонка

fxОткрыть калькулятор 

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

ex

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

10) Процентная ставка Васичека

fxОткрыть калькулятор 

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

ex

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



11) Размер позиции на Форексе

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

[Открыть калькулятор !\[\]\(d3fb9f94af8b26d1c844efa9a98805b0_img.jpg\)](#)

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

12) Теория паритета покупательной способности с использованием инфляции

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

[Открыть калькулятор !\[\]\(e1d6102fe77919492c04879c8450f1f5_img.jpg\)](#)

$$\text{ex} \quad 0.037313 = \left(\frac{1 + 0.39}{1 + 0.34} \right) - 1$$

13) Трехфакторная модель Фамы-Френча

$$\text{fx}$$
[Открыть калькулятор !\[\]\(ab4e2b3fc7e7887b7a72f548aa6f5e60_img.jpg\)](#)

$$R_{\text{ex}} = \alpha_i + \beta_F \cdot (R_{\text{mkt}} - R_f) + (s_i \cdot \text{SMB} + h_{\text{ml}} + E_i)$$

$$\text{ex} \quad 23.134 = 8 + 0.07 \cdot (6.5 - 0.30) + (2.5 \cdot 3.5 + 4.5 + 1.45)$$

14) Форвардный курс

$$\text{fx} \quad F_o = S_p \cdot \ln((r_d - r_f) \cdot T)$$

[Открыть калькулятор !\[\]\(21226b58c700e5231ab98d27101bac58_img.jpg\)](#)

$$\text{ex} \quad 40.86411 = 21 \cdot \ln((0.90 - 0.20) \cdot 10)$$



Используемые переменные

- **a** Скорость изменения среднего значения
- **A_E** Средства на счете
- **b** Долгосрочное среднее значение
- **BSV** Базовая стоимость
- **C** Теоретическая цена опциона колл
- **c₀** Звонок Премии
- **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
- R_{mkt} Рыночный портфель
- r_t Короткая ставка
- R_{exc} 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



Константы, функции, используемые измерения

- **Функция: `exp`**, `exp(Number)`

В показательной функции значение функции изменяется на постоянный коэффициент при каждом изменении единицы независимой переменной.

- **Функция: `ln`**, `ln(Number)`

Натуральный логарифм, также известный как логарифм по основанию e , является обратной функцией натуральной показательной функции.

- **Функция: `max`**, `max(a1, ..., an)`

Максимум функции — это наибольшее значение, которое функция может вывести для любого возможного входа.

- **Функция: `sqrt`**, `sqrt(Number)`

Функция извлечения квадратного корня — это функция, которая принимает на вход неотрицательное число и возвращает квадратный корень из заданного входного числа.



Проверьте другие списки формул

- **Доходность облигаций**
Формулы 
- **Форекс-менеджмент**
Формулы 
- **Калькулятор процентных ставок** Формулы 
- **Возврат инвестиций (ROI)**
Формулы 

Не стесняйтесь ПОДЕЛИТЬСЯ этим документом с друзьями!

PDF Доступен в

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

4/16/2024 | 3:35:00 PM UTC

[Пожалуйста, оставьте свой отзыв здесь...](#)

