

Importante Gestão Forex Fórmulas PDF



Fórmulas Exemplos com unidades

Lista de 14 Importante Gestão Forex Fórmulas

1) Distribuição Cumulativa Dois Fórmula

Fórmula

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

Exemplo

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

Avaliar Fórmula

2) Distribuição Cumulativa Um Fórmula

Fórmula

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

Exemplo

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

Avaliar Fórmula

3) Lucro para comprador de chamadas Fórmula

Fórmula

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

Exemplo

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

Avaliar Fórmula

4) Modelo de crescimento de Gordon Fórmula

Fórmula

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

Exemplo

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

Avaliar Fórmula

5) Modelo de precificação de opções Black-Scholes-Merton para opção de compra Fórmula

Fórmula

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

Exemplo

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

Avaliar Fórmula



6) Modelo de precificação de opções Black-Scholes-Merton para opção de venda Fórmula

Fórmula

Avaliar Fórmula 

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

Exemplo

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

7) Modelo de três fatores Fama-Francês Fórmula

Fórmula

Avaliar Fórmula 

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

Exemplo

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

8) Pagamento para comprador de chamadas Fórmula

Fórmula

Exemplo

Avaliar Fórmula 

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

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

9) Paridade da taxa de juros Fórmula

Fórmula

Exemplo

Avaliar Fórmula 

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

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

10) Tamanho da posição em Forex Fórmula

Fórmula

Exemplo

Avaliar Fórmula 

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

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

11) Taxa de juros de Vasicek Fórmula

Fórmula

Exemplo

Avaliar Fórmula 

$$dr_t = a \cdot (b - r_t) \cdot dt + \sigma \cdot dW_t$$

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

12) Taxa futura Fórmula

Fórmula

Exemplo

Avaliar Fórmula 

$$F_0 = Sp \cdot \ln((r_d - r_f) \cdot T)$$

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



13) Teoria da paridade do poder de compra usando inflação Fórmula

Fórmula

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

Exemplo

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

Avaliar Fórmula 

14) Valor intrínseco Fórmula

Fórmula

$$ITV = SP - BSV$$

Exemplo

$$1.6 = 1.85 - 0.25$$

Avaliar Fórmula 



Variáveis usadas na lista de Gestão Forex Fórmulas acima

- **a** Velocidade de reversão média
- **A_E** Patrimônio da conta
- **b** Média de longo prazo
- **BSV** Valor Base
- **C** Preço teórico da opção de compra
- **c₀** Ligue para Premium
- **d** Derivados
- **D** Dividendo por ação
- **D₁** Distribuição Cumulativa 1
- **D₂** Distribuição Cumulativa 2
- **dr_t** Derivada da taxa curta
- **E_f** Fator de taxa de câmbio
- **E_i** Termo de erro
- **F_o** Taxa futura
- **g** Taxa de crescimento constante de dividendos
- **h_{ml}** Sensibilidade do ativo ao HML
- **I_B** Taxa de juros da moeda base
- **I_Q** Taxa de juros da moeda de cotação
- **ITV** Valor intrínseco
- **K** Preço de exercício da opção
- **k_f** Constante de taxa futura
- **P** Preço teórico da opção de venda
- **P_C** Preço atual das ações
- **P_{normal}** Distribuição normal
- **PCB** Pagamento para comprador de chamadas
- **Pf** Tamanho da posição em Forex
- **Pft** Lucro para comprador de chamadas
- **r_d** Taxa de juros interna
- **R_{f%}** Porcentagem de risco em Forex
- **r_f** Taxa de juros estrangeira
- **R_f** Taxa livre de risco
- **R_{mkt}** Retorno sobre o portfólio de mercado

Constantes, funções, medidas usadas na lista de Gestão Forex Fórmulas acima

- **Funções: exp, exp(Number)**
Em uma função exponencial, o valor da função muda por um fator constante para cada mudança unitária na variável independente.
- **Funções: ln, ln(Number)**
O logaritmo natural, também conhecido como logaritmo de base e, é a função inversa da função exponencial natural.
- **Funções: max, max(a1, ..., an)**
O máximo de uma função é o valor mais alto que a função pode gerar para qualquer entrada possível.
- **Funções: sqrt, sqrt(Number)**
Uma função de raiz quadrada é uma função que recebe um número não negativo como entrada e retorna a raiz quadrada do número de entrada fornecido.



- r_t Taxa curta
- **Rexc** Excesso de retorno sobre ativos
- **RR** Taxa requerida de retorno
- **S_{LP}** Stop Loss em Pips
- **S_T** Preço do ativo subjacente no vencimento
- **si** Sensibilidade do ativo para pequenas e médias empresas
- **SMB** Pequeno Menos Grande
- **Sp** Taxa de câmbio à vista
- **SP** Compartilhar preços
- **t** Período de tempo
- **T** Hora de Maturidade
- **t_s** Hora de expirar o estoque
- **v_{us}** Ações subjacentes voláteis
- **W_t** Risco de mercado aleatório
- **X** Preço do exercício
- **αi** Alfa Específico do Ativo
- **β_F** Beta em Forex
- **If** Inflação em país estrangeiro
- **Ih** Inflação no país de origem
- **P_{VF}** Valor do pip em Forex
- **σ** Volatilidade no tempo



Baixe outros PDFs de Importante Investimento

- [Importante Rendimento de obrigações](#)
- [Importante Gestão Forex Fórmulas](#)
- [Fórmulas](#)

Experimente nossas calculadoras visuais exclusivas

-  [Multiplicar fração](#)
-  [MDC de três números](#)

Por favor, **COMPARTILHE** este PDF com alguém que precise dele!

Este PDF pode ser baixado nestes idiomas

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

7/9/2024 | 6:18:50 AM UTC

