

Importante Gestione del Forex Formule PDF



**Formule
Esempi
con unità**

Lista di 14 Importante Gestione del Forex Formule

1) Dimensione della posizione nel Forex Formula

Formula

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

Esempio

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

Valutare la formula 

2) Distribuzione cumulativa due Formula

Formula

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

Esempio

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

Valutare la formula 

3) Distribuzione cumulativa uno Formula

Formula

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

Esempio

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

Valutare la formula 

4) Modello a tre fattori Fama-francese Formula

Formula

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

Esempio

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

Valutare la formula 

5) Modello di crescita di Gordon Formula

Formula

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

Esempio

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

Valutare la formula 



6) Modello di prezzo dell'opzione Black-Scholes-Merton per l'opzione call Formula

Formula

Valutare la formula 

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

Esempio

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

7) Modello di prezzo dell'opzione Black-Scholes-Merton per l'opzione Put Formula

Formula

Valutare la formula 

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

Esempio

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

8) Parità del tasso di interesse Formula

Formula

Esempio

Valutare la formula 

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

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

9) Payoff per l'acquirente della chiamata Formula

Formula

Esempio

Valutare la formula 

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

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

10) Profitto per l'acquirente della chiamata Formula

Formula

Esempio

Valutare la formula 

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

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

11) Tasso a termine Formula

Formula

Esempio

Valutare la formula 

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

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

12) Tasso di interesse Vasicek Formula

Formula

Esempio

Valutare la formula 

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

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



13) Teoria della parità del potere d'acquisto utilizzando l'inflazione Formula

Formula

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

Esempio

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

Valutare la formula 

14) Valore intrinseco Formula

Formula

$$ITV = SP - BSV$$

Esempio

$$1.6 = 1.85 - 0.25$$

Valutare la formula 



Variabili utilizzate nell'elenco di Gestione del Forex Formule sopra

- **a** Velocità di inversione della media
- **A_E** Equità del conto
- **b** Media a lungo termine
- **BSV** Valore base
- **C** Prezzo teorico dell'opzione call
- **c₀** Chiama Premium
- **d** Derivati
- **D** Dividendo per azione
- **D₁** Distribuzione cumulativa 1
- **D₂** Distribuzione cumulativa 2
- **dr_t** Derivato del tasso breve
- **E_f** Fattore di tasso di cambio
- **E_i** Termine di errore
- **F_O** Tasso a termine
- **g** Tasso di crescita costante del dividendo
- **h_{ml}** Sensibilità dell'asset all'HML
- **I_B** Tasso di interesse della valuta di base
- **I_Q** Tasso di interesse della valuta di quotazione
- **ITV** Valore intrinseco
- **K** Prezzo di esercizio dell'opzione
- **k_f** Costante del tasso di andata
- **P** Prezzo teorico dell'opzione put
- **P_C** Prezzo attuale delle azioni
- **P_{normal}** Distribuzione normale
- **PCB** Payoff per l'acquirente della chiamata
- **Pf** Dimensione della posizione nel Forex
- **Pft** Profitto per l'acquirente della chiamata
- **r_d** Tasso di interesse domestico
- **R_{f%}** Percentuale di rischio nel Forex
- **r_f** Tasso di interesse estero
- **R_f** Tasso esente da rischio
- **R_{mkt}** Rendimento del portafoglio di mercato

Costanti, funzioni, misure utilizzate nell'elenco di Gestione del Forex Formule sopra

- **Funzioni: exp**, exp(Number)
In una funzione esponenziale, il valore della funzione cambia di un fattore costante per ogni variazione unitaria della variabile indipendente.
- **Funzioni: ln**, ln(Number)
Il logaritmo naturale, detto anche logaritmo in base e, è la funzione inversa della funzione esponenziale naturale.
- **Funzioni: max**, max(a1, ..., an)
Il massimo di una funzione è il valore più alto che la funzione può restituire per qualsiasi input possibile.
- **Funzioni: sqrt**, sqrt(Number)
Una funzione radice quadrata è una funzione che accetta un numero non negativo come input e restituisce la radice quadrata del numero di input specificato.



- r_t Tasso breve
- **Rexc** Rendimento eccessivo delle attività
- **RR** Tasso di rendimento richiesto
- **S_{LP}** Stop Loss in Pip
- **S_T** Prezzo del sottostante alla scadenza
- **si** Sensibilità dell'asset alle PMI
- **SMB** Piccolo meno grande
- **Sp** Tasso di cambio a pronti
- **SP** Prezzo delle azioni
- **t** Periodo di tempo
- **T** Tempo alla maturità
- **t_s** Tempo alla scadenza delle azioni
- **v_{us}** Azioni sottostanti volatili
- **W_t** Rischio di mercato casuale
- **X** Prezzo dell'esercizio
- **α_i** Alfa specifico dell'asset
- **β_F** Beta nel Forex
- **If** Inflazione in paese estero
- **Ih** Inflazione nel paese d'origine
- **P_{VF}** Valore del pip nel Forex
- **σ** Volatilità nel tempo



Scarica altri PDF Importante Investimento

- **Importante Rendimento obbligazionario Formule** 
- **Importante Gestione del Forex Formule** 

Prova i nostri calcolatori visivi unici

-  **Diminuzione percentuale** 
-  **MCD di tre numeri** 
-  **Moltiplicare frazione** 

Per favore **CONDIVIDI** questo PDF con qualcuno che ne ha bisogno!

Questo PDF può essere scaricato in queste lingue

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

7/9/2024 | 6:18:43 AM UTC

