

Wichtig Forex-Management Formeln PDF



Formeln Beispiele mit Einheiten

Liste von 14 Wichtig Forex-Management Formeln

1) Auszahlung für Call-Käufer Formel

Formel

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

Beispiel

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

Formel auswerten 

2) Black-Scholes-Merton-Optionspreismodell für Call-Optionen Formel

Formel

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

Beispiel

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

Formel auswerten 

3) Black-Scholes-Merton-Optionspreismodell für Put-Optionen Formel

Formel

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

Beispiel

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

Formel auswerten 

4) Fama-Französisches Drei-Faktoren-Modell Formel

Formel

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

Beispiel

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

Formel auswerten 

5) Forward-Rate Formel

Formel

$$F_o = S_p \cdot \ln((r_d - r_f) \cdot T)$$

Beispiel

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

Formel auswerten 



6) Gewinn für Call-Käufer Formel ↻

Formel

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

Beispiel

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

Formel auswerten ↻

7) Gordon-Wachstumsmodell Formel ↻

Formel

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

Beispiel

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

Formel auswerten ↻

8) Innerer Wert Formel ↻

Formel

$$ITV = SP - BSV$$

Beispiel

$$1.6 = 1.85 - 0.25$$

Formel auswerten ↻

9) Kaufkraftparitätstheorie unter Verwendung der Inflation Formel ↻

Formel

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

Beispiel

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

Formel auswerten ↻

10) Kumulierte Verteilung Eins Formel ↻

Formel

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

Beispiel

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

Formel auswerten ↻

11) Kumulierte Verteilung Zwei Formel ↻

Formel

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

Beispiel

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

Formel auswerten ↻

12) Positionsgröße im Forex Formel ↻

Formel

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

Beispiel

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

Formel auswerten ↻

13) Vasicek-Zinssatz Formel ↻

Formel

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

Beispiel

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

Formel auswerten ↻



14) Zinsparität Formel

Formel

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

Beispiel

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

Formel auswerten 



In der Liste von Forex-Management Formeln oben verwendete Variablen

- **a** Geschwindigkeit der Mittelwertumkehr
- **A_E** Kontoeigenkapital
- **b** Langfristiger Mittelwert
- **BSV** Basiswert
- **C** Theoretischer Preis der Call-Option
- **c₀** Premium anrufen
- **d** Derivate
- **D** Dividende je Aktie
- **D₁** Kumulierte Verteilung 1
- **D₂** Kumulierte Verteilung 2
- **dr_t** Ableitung des Short Rate
- **E_f** Wechselkursfaktor
- **E_i** Fehlerbegriff
- **F₀** Forward-Rate
- **g** Konstante Wachstumsrate der Dividende
- **h_{ml}** Empfindlichkeit des Assets gegenüber HML
- **I_B** Zinssatz der Basiswährung
- **I_Q** Zinssatz der Angebotswährung
- **ITV** Innerer Wert
- **K** Optionsausübungspreis
- **k_f** Forward-Rate-Konstante
- **P** Theoretischer Preis der Put-Option
- **P_C** Aktueller Aktienkurs
- **P_{normal}** Normalverteilung
- **PCB** Auszahlung für Call-Käufer
- **Pf** Positionsgröße im Forex
- **Pft** Gewinn für Call-Käufer
- **r_d** Inländischer Zinssatz
- **R_{f%}** Risikoprozentsatz im Forex
- **r_f** Ausländischer Zinssatz
- **R_f** Risikofreier Zinssatz
- **R_{mkt}** Return-on-Market-Portfolio

Konstanten, Funktionen, Messungen, die in der Liste von Forex-Management Formeln oben verwendet werden

- **Funktionen:** **exp**, exp(Number)
Bei einer Exponentialfunktion ändert sich der Funktionswert bei jeder Einheitsänderung der unabhängigen Variablen um einen konstanten Faktor.
- **Funktionen:** **ln**, ln(Number)
Der natürliche Logarithmus, auch Logarithmus zur Basis e genannt, ist die Umkehrfunktion der natürlichen Exponentialfunktion.
- **Funktionen:** **max**, max(a1, ..., an)
Das Maximum einer Funktion ist der höchste Wert, den die Funktion für eine mögliche Eingabe ausgeben kann.
- **Funktionen:** **sqrt**, sqrt(Number)
Eine Quadratwurzelfunktion ist eine Funktion, die eine nicht negative Zahl als Eingabe verwendet und die Quadratwurzel der gegebenen Eingabezahl zurückgibt.



- r_t Kurzer Tarif
- **R_{exc}** Überschussrendite
- **R_R** Erforderliche Rendite
- **S_{LP}** Stop-Loss in Pips
- **S_T** Preis des Basiswerts bei Verfall
- **si** Empfindlichkeit des Assets gegenüber SMB
- **SMB** Klein minus Groß
- **S_p** Spot-Wechselkurs
- **SP** Aktienkurs
- **t** Zeitraum
- **T** Zeit zur Reife
- **t_s** Zeit bis zum Verfall des Lagerbestands
- **v_{us}** Volatile zugrunde liegende Aktie
- **W_t** Zufälliges Marktrisiko
- **X** Ausübungspreis
- **α_i** Assetspezifisches Alpha
- **β_F** Beta im Forex
- **I_f** Inflation im Ausland
- **I_h** Inflation im Heimatland
- **P_{VF}** Pip-Wert im Forex
- **σ** Volatilität zur Zeit



Laden Sie andere Wichtig Investition-PDFs herunter

- **Wichtig Anleiherendite Formeln** 
- **Wichtig Forex-Management Formeln** 

Probieren Sie unsere einzigartigen visuellen Rechner aus

-  **Prozentualer Rückgang** 
-  **GGT von drei zahlen** 
-  **Bruch multiplizieren** 

Bitte TEILEN Sie dieses PDF mit jemandem, der es braucht!

Dieses PDF kann in diesen Sprachen heruntergeladen werden

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

7/9/2024 | 6:18:33 AM UTC

