



[calculatoratoz.com](http://calculatoratoz.com)



[unitsconverters.com](http://unitsconverters.com)

# Zarządzanie rynkiem Forex Formuły

Kalkulatory!

Przykłady!

konwersje!

Zakładka [calculatoratoz.com](http://calculatoratoz.com), [unitsconverters.com](http://unitsconverters.com)

Najszerzy zasięg kalkulatorów i rośnięcie - **30 000+ kalkulatorów!**  
Oblicz z inną jednostką dla każdej zmiennej - **W wbudowanej konwersji jednostek!**

Najszerzy zbiór miar i jednostek - **250+ pomiarów!**

Nie krępuj się UDOSTĘPNIJ ten dokument swoim  
znajomym!

[Zostaw swoją opinię tutaj...](#)



# Lista 14 Zarządzanie rynkiem Forex Formuły

## Zarządzanie rynkiem Forex

### 1) Dystrybucja skumulowana druga

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

[Otwórz kalkulator !\[\]\(a870788d6ed9b8fd294b7654a8c8526b\_img.jpg\)](#)

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

### 2) Dystrybucja skumulowana pierwsza

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

[Otwórz kalkulator !\[\]\(c50c8b7b2cc2cf9ff925edec0ee94c0d\_img.jpg\)](#)

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

### 3) Kurs terminowy

$$fx \quad F_o = Sp \cdot \ln((r_d - r_f) \cdot T)$$

[Otwórz kalkulator !\[\]\(f60b7a900783ac3fd531bfd9c111be6d\_img.jpg\)](#)

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




4) Model trójczynnikowy Famy-Francuza 

fx

Otwórz kalkulator 

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

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


5) Model wyceny opcji Blacka-Scholesa-Mertona dla opcji kupna 

fx

Otwórz kalkulator 

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

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

6) Model wyceny opcji Blacka-Scholesa-Mertona dla opcji sprzedaży 

fx

Otwórz kalkulator 

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

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

7) Model wzrostu Gordona 


fx

Otwórz kalkulator 

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

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



8) Parytet stóp procentowych 

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

Otwórz kalkulator 

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

9) Rozmiar pozycji na rynku Forex 

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

Otwórz kalkulator 

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

10) Stopa procentowa Vasicka 

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

Otwórz kalkulator 

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

11) Teoria parytetu siły nabywczej z wykorzystaniem inflacji 

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

Otwórz kalkulator 

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



## 12) Wewnętrzna wartość

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

[Otwórz kalkulator !\[\]\(e2376d476d06eb31946dc01a69a4403a\_img.jpg\)](#)

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

## 13) Zapłata dla kupującego połączenie

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

[Otwórz kalkulator !\[\]\(0b5e7e25e8775f7e7e80906ada4f0021\_img.jpg\)](#)

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

## 14) Zysk dla kupującego połączenie

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

[Otwórz kalkulator !\[\]\(bd3b31712ad9bab5a241210fa6925cdd\_img.jpg\)](#)

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



## Używane zmienne

- **a** Szybkość średniego odwrócenia
- **A<sub>E</sub>** Kapitał konta
- **b** Średnia długoterminowa
- **BSV** Wartość podstawowa
- **C** Teoretyczna cena opcji kupna
- **c<sub>0</sub>** Zadzwoń do Premium
- **d** Pochodne
- **D** Dywidenda na akcję
- **D<sub>1</sub>** Dystrybucja skumulowana 1
- **D<sub>2</sub>** Dystrybucja skumulowana 2
- **dr<sub>t</sub>** Pochodna krótkiej stopy procentowej
- **E<sub>f</sub>** Współczynnik kursu wymiany
- **E<sub>i</sub>** Termin błędu
- **F<sub>o</sub>** Kurs terminowy
- **g** Stała stopa wzrostu dywidendy
- **h<sub>ml</sub>** Wrażliwość składnika aktywów na HML
- **I<sub>B</sub>** Stopa procentowa waluty bazowej
- **I<sub>Q</sub>** Stopa procentowa waluty kwotowanej
- **ITV** Wewnętrzna wartość
- **K** Cena wykonania opcji
- **k<sub>f</sub>** Stała stawka forward
- **P** Teoretyczna cena opcji sprzedaży



- $P_c$  Aktualna cena akcji
- $P_{normal}$  Normalna dystrybucja
- $PCB$  Zapłata dla kupującego połączenie
- $P_f$  Rozmiar pozycji na rynku Forex
- $P_{ft}$  Zysk dla kupującego połączenie
- $r_d$  Krajowa stopa procentowa
- $R_{f\%}$  Procent ryzyka na rynku Forex
- $r_f$  Zagraniczna stopa procentowa
- $R_f$  Stopa wolna od ryzyka
- $R_{mkt}$  Zwrot na portfelu rynkowym
- $r_t$  Krótka stawka
- $R_{exc}$  Nadwyżka zwrotu z aktywów
- $RR$  Wymagana stopa zwrotu
- $S_{LP}$  Zatrzymaj stratę w pipsach
- $S_T$  Cena instrumentu bazowego w momencie wygaśnięcia
- $si$  Wrażliwość aktywów na SMB
- $SMB$  Mały Minus Duży
- $Sp$  Kurs wymiany
- $SP$  Cena akcji
- $t$  Okres czasu
- $T$  Czas na Dojrzałość
- $t_s$  Czas do wygaśnięcia zapasów
- $v_{us}$  Zmienne akcje bazowe
- $W_t$  Losowe ryzyko rynkowe



- **X** Cena zadania
- **$\alpha_i$**  Wersja alfa dotycząca konkretnych zasobów
- **$\beta_F$**  Beta na rynku Forex
- **If** Inflacja za granicą
- **Ih** Inflacja w kraju macierzystym
- **$P_{VF}$**  Wartość pipsa na rynku Forex
- **$\sigma$**  Zmienność w czasie





## Stałe, funkcje, stosowane pomiary

- **Funkcjonować: exp**,  $\text{exp}(\text{Number})$   
*w przypadku funkcji wykładniczej wartość funkcji zmienia się o stały współczynnik przy każdej zmianie jednostki zmiennej niezależnej.*
- **Funkcjonować: ln**,  $\text{ln}(\text{Number})$   
*Logarytm naturalny, znany również jako logarytm o podstawie e, jest funkcją odwrotną do naturalnej funkcji wykładniczej.*
- **Funkcjonować: max**,  $\text{max}(a_1, \dots, a_n)$   
*Maksimum funkcji to najwyższa wartość, jaką funkcja może wyprowadzić dla dowolnego możliwego wejścia.*
- **Funkcjonować: sqrt**,  $\text{sqrt}(\text{Number})$   
*Funkcja pierwiastka kwadratowego to funkcja, która jako dane wejściowe przyjmuje liczbę nieujemną i zwraca pierwiastek kwadratowy z podanej liczby wejściowej.*



## Sprawdź inne listy formuł

- [Bond Yield Formuły](#) 
- [Zarządzanie rynkiem Forex Formuły](#) 
- [Kalkulator stóp procentowych Formuły](#) 
- [Zwrot z inwestycji \(ROI\) Formuły](#) 

Nie krępuj się UDOSTĘPNIJ ten dokument swoim znajomym!

## PDF Dostępne w

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

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

[Zostaw swoją opinię tutaj...](#)

