

Валютные операции на рынке FOREX

Исходные данные и задание

Необходимо открыть демо-счет в одной из компаний для проведения операций на рынке FOREX (см. лекции о порядке открытия счета)

1. Провести не менее десяти валютных операций. Длительность минимум одной операции должна быть более суток.
2. Распечатать отчет о проведенных операциях.
3. Привести пример расчета прибыли (убытков) минимум для одной операции типа buy
4. Привести пример расчета прибыли (убытков) минимум для одной операции типа sell
5. Минимум по одной операции использовать stop loss
6. Минимум по одной операции использовать take profit
7. Для одной из операций, по которой приведен пример расчета прибыли (убытков), представить график изменения курсов по рассматриваемой паре валют с указанием момента начала и окончания операции
8. Для операции с продолжительностью более суток рассчитать swap. Процентную ставку по одной из валют принять произвольно в диапазоне от 1 до 5%. Процентную ставку по второй валюте рассчитать на основе известной информации о swap.

Методические рекомендации по выполнению задания

Вариант отчета о работе на рынке FOREX может быть следующим:

Western Capital Forex SA

Account: 341192 Name: Irene Melnikova Currency: USD 2006 December 11, 19:20

Closed Transactions:

Ticket	Open Time	Type	Lots	Item	Price	S/L	T/P	Close Time	Price	Commission	Taxes	Swap	Profit	
6062075	2006.12.06 15:02	balance		Deposit									5000.00	
6062410	2006.12.06 15:04	buy	0.30	eurjpy	152.97	0.00	0.00	2006.12.06 15:25	152.97	0.00	0.00	0.00	0.00	
6062496	2006.12.06 15:16	sell	0.30	eurjpy	152.58	0.00	0.00	2006.12.06 15:27	152.58	0.00	0.00	0.00	1.41	
6062481	2006.12.06 15:30	buy	0.30	eurusd	1.3252	0.0000	0.0000	2006.12.06 15:45	1.3270	0.00	0.00	0.00	1.68	
6062385	2006.12.06 15:32	sell	0.30	eurusd	1.3251	0.0000	0.0000	2006.12.06 15:37	1.3252	0.00	0.00	0.00	0.00	
6062856	2006.12.07 17:30	sell	1.00	usdjpy	115.16	0.00	0.00	2006.12.07 20:28	115.15	0.00	0.00	0.00	0.68	
6091104	2006.12.07 17:47	sell	2.00	eurusd	1.6029	0.0000	0.0000	2006.12.07 10:21	1.6030	0.00	0.00	0.00	15.01	
6091140	2006.12.07 17:49	buy	0.30	eurusd	1.3000	0.0000	1.0000	2006.12.06 07:48	1.3051	0.00	0.00	0.00	15.04	
6090200	2006.12.07 20:16	sell	1.00	eurusd	1.3230	0.0000	0.0000	2006.12.07 21:40	1.3221	0.00	0.00	0.00	9.00	
6090484	2006.12.07 21:31	buy	1.00	eurjpy	152.09	0.00	153.18	2006.12.07 08:17	152.18	0.00	0.00	0.00	8.25	
6091179	2006.12.07 21:38	sell	3.00	eurusd	1.3279	0.0000	0.0000	2006.12.07 14:10	1.3276	0.00	0.00	4.00	9.00	
6404140	2006.12.08 13:01	buy	4.00	eurjpy	153.55	0.00	153.60	2006.12.08 15:32	153.50	0.00	0.00	0.00	173.71	
6404180	2006.12.08 13:03	buy	1.00	usdusd	1.1074	0.0000	1.1088	2006.12.08 15:31	1.1088	0.00	0.00	0.00	11.57	
6404271	2006.12.08 13:09	buy	3.00	usdjpy	115.37	0.00	0.00	2006.12.08 15:36	115.74	0.00	0.00	0.00	151.46	
6400115	2006.12.08 14:12	sell	5.00	eurusd	1.3274	0.0000	0.0000	2006.12.08 15:00	1.3239	0.00	0.00	0.00	30.00	
6402770	2006.12.08 15:07	sell	5.00	gbpjpy	225.09	225.10	0.0000	2006.12.08 16:17	225.09	0.00	0.00	0.00	-100.17	
6402717	2006.12.08 15:10	buy	2.00	gbpjpy	225.09	0.00	225.02	2006.12.08 16:15	225.00	0.00	0.00	0.00	57.70	
6402995	2006.12.08 15:08	sell	1.00	gbpjpy	225.02	0.00	0.00	2006.12.08 16:14	225.08	0.00	0.00	0.00	34.26	
6412107	2006.12.08 17:09	buy	1.00	eurjpy	152.00	0.00	0.00	2006.12.08 17:10	152.01	0.00	0.00	0.00	10.37	
6412092	2006.12.08 18:00	buy	1.00	gbpjpy	225.09	0.00	225.10	2006.12.11 00:20	225.10	0.00	0.00	0.00	0.00	
6412434	2006.12.08 18:49	buy	1.00	eurusd	1.3234	0.0000	1.3242	2006.12.11 19:12	1.3242	0.00	0.00	0.00	8.00	
6414050	2006.12.11 14:17	buy	1.00	eurjpy	154.07	0.00	154.09	2006.12.11 17:15	154.09	0.00	0.00	0.00	17.70	
6412103	2006.12.11 15:00	sell	0.30	usdsd	1.1227	0.0000	0.0000	2006.12.11 10:39	1.1220	0.00	0.00	0.00	15.40	
6412205	2006.12.11 15:52	buy	0.30	gbpjpy	225.04	0.00	225.01	2006.12.11 17:39	225.01	0.00	0.00	0.00	45.00	
										0.00	0.00	19.50	90.47	
													Closed P/L:	919.19

Open Trades:

Ticket	Open Time	Type	Lots	Item	Price	S/L	T/P	Market Price	Commission	Taxes	Swap	Profit	
6407387	2006.12.08 15:37	buy	2.00	eurjpy	167.54	0.0000	0.6786	167.55	0.00	0.00	0.00	24.78	
6412090	2006.12.11 14:57	buy	0.30	gbpjpy	225.09	0.0000	2.0544	225.02	0.00	0.00	0.00	-2.44	
6412002	2006.12.11 15:11	buy	2.00	gbpjpy	225.07	0.0000	2.0537	225.02	0.00	0.00	0.00	-0.22	
6412440	2006.12.11 15:57	buy	0.30	usdsd	1.1226	0.0000	1.1199	1.1259	0.00	0.00	0.00	-1.14	
									0.00	0.00	-1.00	-9.11	
												Floating P/L:	-0.9648

Working Orders:

Ticket	Open Time	Type	Lots	Item	Price	S/L	T/P	Market Price
No transactions								

Summary:

Deposit/Withdrawal:	5 000.00	Credit Facility:	0.00
Closed Trade P/L:	919.19	Floating P/L:	925.98
Balance:	5 919.19	Equity:	4 993.26
		Margin:	1 489.87
		Free Margin:	3 503.39

Пример расчета для операции 6363284:

В 15.30 06 декабря 2006 года за USD купили 0,3 лота EUR (100000*0.3=30000) по курсу 1,3264 USD/EUR.

В 15.45 06 декабря 2006 года EUR были проданы за USD по курсу 1,3270 USD/EUR.

	1,3264 USD/EUR		1,3270 USD/EUR	
USD	→	EUR	→	USD
↓	a	↓	b	↓
39792		30000		39810

- a) Рассчитаем количество USD, необходимое для покупки 30000 EUR
 $Q_{USD}/1,3264 \text{ USD/EUR} = 30000 \text{ EUR}$
 $Q_{USD} = 30000 \text{ EUR} * 1,3264 \text{ USD/EUR} = 39792 \text{ USD}$
b) $30000 \text{ EUR} * 1,3270 \text{ USD/EUR} = 39810 \text{ USD}$
Прибыль (Profit) = $39810 - 39792 = 18 \text{ USD}$

Пример расчета для операции 6394129:

В 21.48 07 декабря 2006 года продали 3 лот (300000) EUR в обмен на USD по курсу 1,3279 USD/EUR.

В 14.10 08 декабря 2006 года USD были проданы за EUR по курсу 1,3276 USD/EUR.

	1,3279 USD/EUR		1,3276 USD/EUR	
EUR	→	USD	→	EUR
↓	a	↓	b	↓
300000		398370		300067,79

- a) $300000 \text{ EUR} * 1,3279 \text{ USD/EUR} = 398370 \text{ USD}$
b) $398370 \text{ USD} / 1,3276 \text{ USD/EUR} = 300067,79 \text{ EUR}$
Прибыль (Profit) = $300067,79 \text{ EUR} - 300000 \text{ EUR} = 67,79 \text{ EUR}$
Пересчет прибыли в USD: $67,79 \text{ EUR} * 1,3276 \text{ USD/EUR} = 90 \text{ USD}$

Расчет swap по этой операции:

Длительность операции - 1 день. Следовательно, был использован кредит 300000 EUR европейского банка на 1 день.

398370 USD один день находились в американском банке на депозитном счете.

Предположим, в европейском банке используется ставка 3 % годовых.

$$\frac{300000 \text{ EUR} * 3 * 1}{360 * 100} = 25 \text{ EUR} \text{ — проценты, которые необходимо заплатить}$$

европейскому банку. Пересчет в USD: $25 \text{ EUR} * 1,3276 \text{ USD/EUR} = 33,19 \text{ USD}$.

Предположим, ставка в американском банке X % годовых.

$$\frac{398370 \text{ USD} * X * 1}{360 * 100} \text{ USD — проценты, которые получим от американского}$$

банка.

$$\text{swap} = \frac{398370 \text{ USD} * X * 1}{360 * 100} \text{ USD} - 33,19 \text{ USD} = 4,5 \text{ USD}$$

X=3,41 % (процентная ставка американского банка)

График изменения курсов по рассматриваемой паре валют:

