

## **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
6062436	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	1.18
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	0.00
6091104	2006.12.07 17:47	sell	2.00	eurusd	1.6029	0.0000	0.0000	2006.12.07 18:01	1.6030	0.00	0.00	0.00	0.00
6091140	2006.12.07 17:49	buy	0.30	eurusd	1.5000	0.0000	1.0000	2006.12.07 07:48	1.5001	0.00	0.00	0.00	0.00
6090200	2006.12.07 20:16	sell	1.00	eurusd	1.5230	0.0000	0.0000	2006.12.07 21:40	1.5221	0.00	0.00	0.00	0.00
6090351	2006.12.07 20:38	buy	1.00	eurjpy	152.09	0.00	153.18	2006.12.07 08:07	152.18	0.00	0.00	0.00	0.00
6091109	2006.12.07 21:28	sell	3.00	eurusd	1.4779	0.0000	0.0000	2006.12.07 14:10	1.4775	0.00	0.00	4.00	0.00
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	0.00
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	0.00
6404271	2006.12.08 13:09	buy	3.00	usdjpy	115.37	0.00	0.00	2006.12.08 15:36	115.34	0.00	0.00	0.00	0.00
6400115	2006.12.08 14:12	sell	5.00	eurusd	1.5274	0.0000	0.0000	2006.12.08 15:00	1.5239	0.00	0.00	0.00	0.00
6400270	2006.12.08 15:07	sell	5.00	gbpusd	2.0116	2.0120	0.0000	2006.12.08 16:07	2.0120	0.00	0.00	0.00	0.00
6400271	2006.12.08 15:10	buy	2.00	gbpusd	2.0109	0.00	2.0102	2006.12.08 16:05	2.0100	0.00	0.00	0.00	0.00
6400295	2006.12.08 15:08	sell	1.00	gbpusd	2.0102	0.00	0.00	2006.12.08 16:14	2.0108	0.00	0.00	0.00	0.00
6400207	2006.12.08 17:09	buy	1.00	eurjpy	151.50	0.00	0.00	2006.12.08 17:10	151.47	0.00	0.00	0.00	0.00
6400091	2006.12.08 18:00	buy	1.00	gbpusd	2.0109	0.00	2.0102	2006.12.08 00:20	2.0109	0.00	0.00	0.00	0.00
6400434	2006.12.08 15:49	buy	1.00	eurusd	1.3234	0.0000	1.3242	2006.12.11 19:12	1.3242	0.00	0.00	0.00	0.00
6404050	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	0.00
6400100	2006.12.11 15:00	sell	0.30	usdsd	1.1427	0.0000	0.0000	2006.12.11 18:09	1.1420	0.00	0.00	0.00	0.00
6400206	2006.12.11 15:52	buy	0.30	gbpusd	2.0104	0.00	2.0101	2006.12.11 17:09	2.0101	0.00	0.00	0.00	0.00
										0.00	0.00	19.35	0.00
													919.19

### Open Trades:

Ticket	Open Time	Type	Lots	Item	Price	S/L	T/P	Price	Commission	Taxes	Swap	Profit
6407387	2006.12.08 15:37	buy	2.00	usdjpy	0.6754	0.0000	0.6786	0.6755	0.00	0.00	0.00	0.00
6400090	2006.12.11 14:57	buy	0.30	gbpusd	2.0109	0.0000	2.0104	2.0102	0.00	0.00	0.00	0.00
6400003	2006.12.11 15:01	buy	2.00	gbpusd	2.0107	0.0000	2.0107	2.0102	0.00	0.00	0.00	0.00
6400430	2006.12.11 15:57	buy	0.30	usdsd	1.1426	0.0000	1.1499	1.1459	0.00	0.00	0.00	0.00
									0.00	0.00	-1.00	0.00
												-0.00

### 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.

3983370 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:

