

№ 236

МИСиС

И.А. Ларионова

Биржевое дело. Операции на валютном рынке

Учебно-методическое пособие

ФЕДЕРАЛЬНОЕ АГЕНТСТВО ПО ОБРАЗОВАНИЮ

№ 236

**МОСКОВСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ
ИНСТИТУТ СТАЛИ и СПЛАВОВ**
Технологический университет



Кафедра экономики и менеджмента

И.А. Ларионова

Биржевое дело. Операции на валютном рынке

Учебно-методическое пособие

Рекомендовано редакционно-издательским
советом института

Москва Издательство «УЧЕБА» 2006

УДК 65.421
Л25

Рецензент
доц., канд. техн. наук *О.Н. Калашикова*

Ларионова И.А.

Л25 Биржевое дело. Операции на валютном рынке: Учеб.-метод. пособие. – М.: МИСиС, 2006. – 38 с.

В работе рассмотрены основные понятия биржевого валютного рынка, а также базовые операции (спот, форвардные, своп, валютные опционы), методы расчета форвардных цен и стоимости опционов, оценки эффективности валютных операций. Дается обзор основных методов технического анализа валютного рынка.

Пособие может быть использовано студентами, обучающимися по специальности 060800 и 351300 при изучении курсов «Биржевое дело» и «Операции с ценными бумагами», а также при изучении выполнении курсовой.

ОГЛАВЛЕНИЕ

Введение	4
1. Базовые понятия	4
2. Основные операции валютного рынка	6
3. Методы определения форвардного курса	9
3.1. Форвардное ценообразование на основе метода линейной экстраполяции ожиданий будущего курса спот	9
3.2. Классический метод	9
4. Модель Гармана и Колхагена для оценки цены опциона	12
5. Технический анализ валютного рынка	15
5.1. Графические методы	15
5.2. Анализ вида тренда	18
5.3. Скользящие средние	21
5.4. Осцилляторы	25
5.5. Стохастический осциллятор Лейна	29
6. Оценка эффективности валютных операций	31
7. Порядок выполнения курсовой работы	33
Библиографический список	34
Приложения	35