

ВАЛЮТНЫЕ ОПЕРАЦИИ. ВАЛЮТНЫЕ КОТИРОВКИ. ВАЛЮТНЫЙ КУРС

Выполнили: Ковалева Надежда
Неретина Александра

Основными участниками валютных рынков являются:

- **коммерческие банки**
- **импортеры и экспортеры, оплачивающие или получающие валюту за товар**
- **инвесторы, приобретающие и продающие иностранные акции**
- **валютные брокеры, осуществляющие операции с валютой по заказу клиента**
- **дилеры, проводящие спекулятивные сделки с валютой**
- **трейдеры валютного рынка**

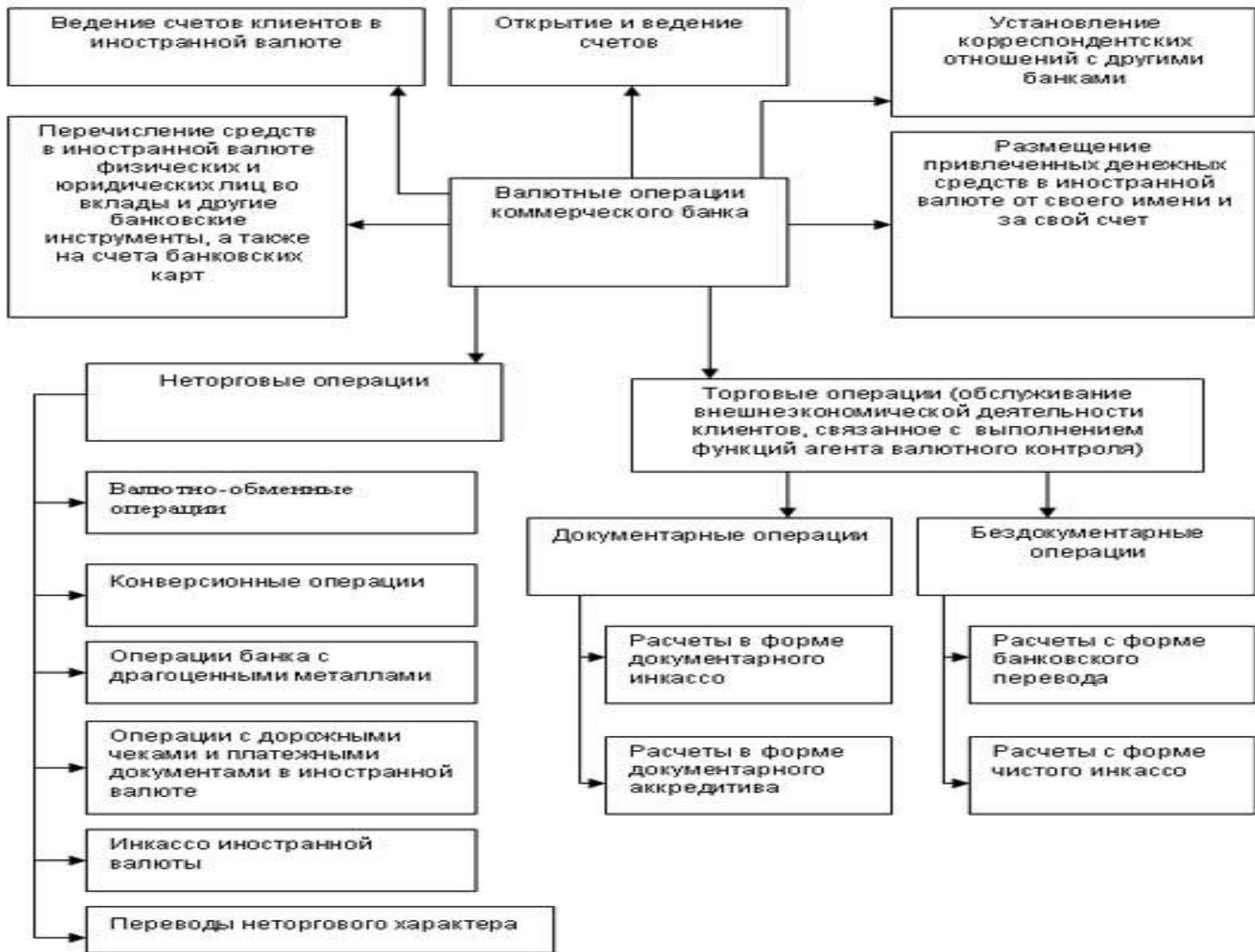
- Операции, осуществляемые банками на валютных рынках
- По принципу субъектов валютных операций различают
 - валютные операции между резидентами Российской Федерации
 - валютные операции резидентов с нерезидентами
- В зависимости от механизма торговли и заключения сделок различают
 - биржевые
 - внебиржевые валютные сделки
- - межбанковские валютные операции
 - клиентские валютные операции

Виды валютных операций в зависимости от срочности их проведения

Вид операции	Описание операции
Срочные операции	Срочные операции принято подразделять на конверсионные, страховые и спекулятивные. К срочным сделкам также относятся «форвард» (forward), «опцион» (option), «своп» (swap).
Наличные операции	Среди наличных валютных операций выделяют операции «спот» (spot), а также такие операции как «овернайт» (overnight), «туморроу/некст» (tomorrow/next) и «дэй-то-дэй своп» (day-to-day swap), которые применяются банками для управления текущими валютными позициями.

В зависимости от экономического содержания операций, они подразделяются на

- конверсионные
- депозитные
- расчетные



ВИДЫ ВАЛЮТНОГО КУРСА

фиксиро
ванный
валютн
ый курс

плаваю
щий

текущий

форвард
ный

кросс-
курс

Валюта	Currency	Буквенный код
Австралийский доллар	Australian Dollar	AUD
Австрийский шиллинг	Austrian Schilling	ATS
Бельгийский франк	Belgian Franc	BEF
Британский фунт	British Pound	GBP
Канадский доллар	Canadian Dollar	CAD
Чешская крона	Czech Koruna	CZK
Датская крона	Danish Krone	DKK
Нидерландский гульден	Dutch Guilder	NLG
Эстонская крона	Estonian Kroon	EEK
Единая европейская валюта	Euro	EUR
Финская марка	Finnish Mark	FIM
Французский франк	French Franc	FRF
Немецкая марка	German Mark	DEM
Гонконгский доллар	Hong Kong Dollar	HKD
Венгерский форинт	Hungarian Forint	HUF
Ирландский фунт	Irish Punt	IEP
Итальянская лира	Italian Lira	ITL
Японская йена	Japanese Yen	JPY

- **Bid -курс, по которому банки покупают торгуемую (иностранную) валюту и продают национальную**
- **Offer - является курсом, по которому банк продает торгуемую валюту и покупает национальную**
- **Спред - величина, на которую курс Bid отличается от курса Offer(Ask)**
- **Кросс-курс — это соотношение между двумя валютами, которое рассчитывают исходя из их курса по отношению к курсу третьей валюты**

**В зависимости от места нахождения биржи,
от страны, где совершается валютная
сделка, различают:**

- **прямая котировка валюты**
- **косвенная котировка валюты**

общая формула расчета кросс-курсов при прямых котировках имеет вид:

- ▣ $K = A / B$

где

K – кросс-курс

A – курс валюты, которую покупают

B – курс валюты, за которую покупают

Расчет кросс-курсов при обратной котировке валют
производится по формуле :

- ▣ $K = B / A$

где

K – кросс-курс

A – курс валюты, которую покупают

B – курс валюты, за которую покупают

Динамика курса USD ЦБ РФ, руб.

Дата	Курс	Изменение
21.11	31,4263	-0,2414
20.11	31,6677	-0,0507
17.11	31,7184	0,0265
16.11	31,6919	-0,0348
15.11	31,7267	0,0103
14.11	31,7164	0,1111
13.11	31,6053	0,1091
10.11	31,4962	-0,0184
09.11	31,5146	0,2113
08.11	31,3033	-0,2162



Курсы валют ЦБ РФ на 21/11/2012

Код	За единиц	Валюты	Рублей РФ
AUD	1	Австралийский доллар	32,6991
GBP	1	Фунт стерлингов	50,0087
BYR	10000	Белорусский рубль	36,9287
DKK	10	Датская крона	53,9146
USD	1	Доллар США	31,4263
EUR	1	Евро	40,2037
KZT	100	Казахский тенге	20,9097
CAD	1	Канадский доллар	31,5335
CNY	10	Китайский юань	50,4451
NOK	10	Норвежская крона	54,7334
XDR	1	СДР	47,9546

Кросс-курсы на 20.11.2012

Кросс	Предл.	Спрос
↓ EUR/RUB	40.116	40.176
↓ GBP/RUB	49.831	49.884
↑ USD/RUB	31.293	31.344
↓ AED/RUB	8.5203	8.5325
↑ ARS/RUB	6.5148	6.5223
↑ AUD/RUB	32.49	32.53
↑ BRL/RUB	15.04	15.06
↑ CAD/RUB	31.38	31.41
↓ CNY/RUB	5.0155	5.0228
↑ CHF/RUB	33.29	33.33
↑ DKK/RUB	5.3773	5.3833
↑ HKD/RUB	4.0405	4.0450
↑ HUF/RUB	0.1427	0.1429