

Международная академия биржевой торговли

Финансовая математика: считаем деньги



Андрей Фёдоров, преподаватель FOREX CLUB

Как мы выяснили в предыдущих статьях, существуют активы с отличным потенциалом. Прибыль — категория хорошая и очень желанная. Но из воздуха она не появляется. О том, сколько средств необходимо для работы на товарных и фондовых рынках через CFD, мы и поговорим в рамках текущей статьи.

Основные параметры контрактов описываются в спецификациях — своего рода паспортах контракта. Например, в них указываются объёмы сделок, о которых мы говорили при рассмотрении качелей на нефтяном рынке. Именно объём сделки и изменчивость цен и позволяют нам определить потенциал заработка на том или ином рынке. Ещё один важный раздел спецификации — это маржинальные требования (или просто — маржа). Маржа указывает на минимальную сумму средств на счёте, которая в принципе необходима для заключения сделки.

Например, в FOREX CLUB контракт на нефть имеет объём 100 баррелей нефти, а маржа составляет \$400. Это технический минимум, который позволит купить или продать один контракт. Но является ли эта сумма достаточной для работы на рынке?

Как мы уже отмечали, с технической точки зрения — да. Сделку мы заключить сможем. Но однозначно не сможем контролировать риски. И вот почему...

Средние изменения цен на нефть марки Brent составляют сейчас порядка \$2,5 (долларов за баррель) в день. Мы помним, что один контракт на нефть в FOREX CLUB имеет объём 100 баррелей. Следовательно, в среднем, результат по сделке будет меняться на плюс/минус \$250 в сутки.

Конечно здорово, если цены будут идти в ту сторону, в которую мы рассчитали. И каждый день будет прибавлять нам, в среднем, по \$250. Если мы совершаем сделку с прицелом на хорошее продолжительное движение, в сделке мы можем находиться от нескольких дней до нескольких недель и даже месяцев. За это время цены краткосрочно могут двигаться, как говорят трейдеры, и против нас. И день такого контрдвижения может отнять \$250. А теперь простой вопрос — на сколько таких дней хватит нашего технического минимума в \$400? Согласитесь, совсем не на много. Охотясь за хорошими движениями, мы должны иметь и хороший запас на своём счёте, чтобы выдержать контрдвижения в течение даже нескольких дней. По самым общим оценкам этот запас должен составлять не менее \$1000 в расчёте на один контракт.

При работе двумя контрактами комфортное обеспечение должно превышать сумму \$2000, пятью контрактами — \$5000 и выше. Да, планка для совершения сделок возрастает, но также возрастает и отдача. Продемонстрируем это на простом примере: при работе пятью контрактами (500 баррелей нефти) и средних изменениях цен на нефть в \$2,5, удачный день в среднем будет приносить \$1250. Как и в любом другом виде бизнеса, большой капитал рождает и большую прибыль. Только не забывайте при этом про риски. А их как раз и контролируют через расчёт комфортного обеспечения по счёту.

FOREX CLUB поддерживает десятки контрактов, через которые трейдеры и инвесторы выходят на валютные, товарные и фондовые рынки. Благодаря этому появляется возможность сформировать весьма обширный инвестиционный портфель. В него могут войти, например, контракты на евро, золото, нефть, акции всем известной «фруктовой компании» Apple Inc. и даже контракты на фондовые индексы! В среднем, каждый такой контракт требует комфортного обеспечения на счёте от \$1000. Для создания простейшего портфеля необходимо не менее \$5000. А для более серьёзных инвестиционных портфелей — от нескольких десятков тысяч долларов. О том, какие принципы лежат в основе формирования инвестиционных портфелей, мы поговорим в нашей следующей статье.

Рекомендуем on-line семинар: **Как зарабатывать на товарном и фондовом рынке**

FOREXCLUB предлагает вам торговать не только валютами, но также более чем пятью десятками **CFD**-контрактов на товары и фондовые активы, в числе которых золото и серебро, нефть и газ, акции таких компаний как Apple Inc., McDonald's Corp., Microsoft Corp.

CFD, Contract For Difference, — финансовый инструмент, позволяющий извлекать прибыль из изменения курса различных товаров и фондовых активов.

На семинаре вы узнаете:

- ✓ каков потенциал этих рынков для получения прибыли
- ✓ в чём нюансы работы с товарными и фондовыми инструментами
- ✓ какие инструменты анализа используют трейдеры для торговли на товарном и фондовом рынке
- ✓ а также, какая связь между древними шумерами, английской шерстью, амстердамской биржей и современной, доступной каждому трейдеру, торговлей контрактами на разницу в цене биржевых товаров и активов ☺

On-line семинар **Как зарабатывать на товарном и фондовом рынке** входит в число тематических on-line семинаров в открытом доступе.

Регистрация на семинар — на сайте FOREX CLUB www.fxclub.org (Обучение — On-line семинары) или на сайте Академии www.traderacademy.ru

