Практична робота 13. Клірингові розрахунки за довгими позиціями

ПІП\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Daily gains and losses and cumulative trading profits and losses

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| Дата  квітень | Травневий ф’ючерс (spot month) | | Розмір 1 контракту – 100 troy ounce  Початкова маржа – 16500 дол.  Підтримуюча – 15000 дол. |
| Ціна виконання контракту USD\ troy ounce | settlement price, USD\ troy ounce |
| 1 | Купівля 1 контракту |  |
| 2 |  |  |
| 3 |  |  |
| 4 |  |  |
| 7 |  |  |
| 8 |  |  |
| 9 |  |  |
| 10 |  |  |
| 11 |  |  |
| 14 |  |  |
| 15 |  |  |
| 16 |  |  |
| 17 |  |  |
| 21 |  |  |
| 22 |  |  |
| 23 |  |  |
| 24 |  |  |
| 25 |  |  |
| 28 |  |  |
| 29 |  |  |  |
| 30 | Продаж 1 контракт |  | Ф’ючерсний контракт на золото травень 2025 |

Table 3. Margin account and account equity

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| дата | transactions  операції | equity грошові розрахунки за відкритим ф’ючерсів | | | marging account маржовий рахунок | | |
|  |  | beginning, $  початок дня | cash flow, $  рух готівки | ending, $  кінець дня | marging call,  маржова вимога $ | deficiency,  дефіцит  $ | Excess,  Надлишок коштів $ |
|  | Депозит 15000 | 0 | +15000 | 15000 | - | - | - |
| 1 | Купівля 1 контракту | 15000 | - | 15000 | - | - | - |
| 2 | депозит 1500 | 16500 |  |  |  |  |  |
| 3 |  |  |  |  |  |  |  |
| 4 |  |  |  |  |  |  |  |
| 7 |  |  |  |  |  |  |  |
| 8 |  |  |  |  |  |  |  |
| 9 |  |  |  |  |  |  |  |
| 10 |  |  |  |  |  |  |  |
| 11 |  |  |  |  |  |  |  |
| 14 |  |  |  |  |  |  |  |
| 15 |  |  |  |  |  |  |  |
| 16 |  |  |  |  |  |  |  |
| 17 |  |  |  |  |  |  |  |
| 21 |  |  |  |  |  |  |  |
| 22 |  |  |  |  |  |  |  |
| 23 |  |  |  |  |  |  |  |
| 24 |  |  |  |  |  |  |  |
| 25 |  |  |  |  |  |  |  |
| 28 |  |  |  |  |  |  |  |
| 29 |  |  |  |  |  |  |  |
| 30 | Продаж 1 контракт |  |  |  |  |  |  |

Практична робота 13. Клірингові розрахунки за короткими позиціями

ПІП\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Daily gains and losses and cumulative trading profits and losses

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| Дата  квітень | Травневий ф’ючерс (spot month) | | Розмір 1 контракту – 5000 troy ounce  Початкова маржа – 16500 дол.  Підтримуюча – 15000 дол. |
| Ціна виконання контракту USD\ troy ounce | settlement price, USD\ troy ounce |
| 1 | Продаж 1 контракт |  |
| 2 |  |  |
| 3 |  |  |
| 4 |  |  |
| 7 |  |  |
| 8 |  |  |
| 9 |  |  |
| 10 |  |  |
| 11 |  |  |
| 14 |  |  |
| 15 |  |  |
| 16 |  |  |
| 17 |  |  |
| 21 |  |  |
| 22 |  |  |
| 23 |  |  |
| 24 |  |  |
| 25 |  |  |
| 28 |  |  |
| 29 |  |  |  |
| 30 | Купівля 1 контракту |  | Ф’ючерсний контракт на срібло травень 2025 |

Table 3. Margin account and account equity

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| дата | transactions  операції | equity грошові розрахунки за відкритим ф’ючерсів | | | marging account маржовий рахунок | | |
|  |  | beginning, $  початок дня | cash flow, $  рух готівки | ending, $  кінець дня | marging call,  маржова вимога $ | deficiency,  дефіцит  $ | Excess,  Надлишок коштів $ |
|  | Депозит 15000 | 0 | +15000 | 15000 | - | - | - |
| 1 | Продаж 1 контракт | 15000 | - | 15000 | - | - | - |
| 2 | депозит 1500 | 16500 |  |  |  |  |  |
| 3 |  |  |  |  |  |  |  |
| 4 |  |  |  |  |  |  |  |
| 7 |  |  |  |  |  |  |  |
| 8 |  |  |  |  |  |  |  |
| 9 |  |  |  |  |  |  |  |
| 10 |  |  |  |  |  |  |  |
| 11 |  |  |  |  |  |  |  |
| 14 |  |  |  |  |  |  |  |
| 15 |  |  |  |  |  |  |  |
| 16 |  |  |  |  |  |  |  |
| 17 |  |  |  |  |  |  |  |
| 21 |  |  |  |  |  |  |  |
| 22 |  |  |  |  |  |  |  |
| 23 |  |  |  |  |  |  |  |
| 24 |  |  |  |  |  |  |  |
| 25 |  |  |  |  |  |  |  |
| 28 |  |  |  |  |  |  |  |
| 29 |  |  |  |  |  |  |  |
| 30 | Купівля 1 контракту |  |  |  |  |  |  |