

Эта часть работы выложена в ознакомительных целях. Если вы хотите получить работу полностью, то приобретите ее воспользовавшись формой заказа на странице с готовой работой:

<https://studservis.ru/gotovye-raboty/otvety-na-bilety/18125>

Тип работы: Ответы на билеты

Предмет: Финансы

-

□ корпоративная отчетность и аналитические данные ведущих компаний.

Наиболее оптимальной формой представления фундаментальной информации считается экономический календарь, который доступен на большинстве сайтов, а также может быть интегрирован в виде информера на любой ресурс.

Существуют различные виды календарей, но все в обязательном содержат перечень основных статистических данных, графиком официальных необходимых показателей с указанием времени публикации, предыдущими значениями и официальным прогнозом. Обработка новостей и первичная оценка их влияния на рынок происходит в реальном времени.

Также источники можно разделить на:

□ первичные источники информации (базовые данные) – отчеты компаний, таблицы с экономической статистикой, данные непосредственно от их поставщиков. Базовые данные нуждаются в обработке и анализе;

□ вторичные источники информации (обработанная информация) – аналитические отчеты, которые опираются на первичные источники. Вторичные источники могут сами по себе давать идеи, без дополнительной обработки.

Некоторые из основных источников информации, которые могут быть использованы для проведения фундаментального анализа, перечислены ниже:

□ Экономика. Экономический фактор может быть критичен для фундаментального анализа. Например, если в определенной стране экономическая ситуация благоприятная: налоговые поступления находятся на достаточно высоком уровне, объем экспорта также достаточен – валюта такой страны обычно будет расти в цене, в сравнении с менее успешными странами. Существует множество примеров тому факту, что общая хорошая экономическая ситуация также оказывает благотворное влияние на стоимость акций основных корпораций, которые расположены в такой стране. Очевидно, что верно и обратное – валюта страны, которая переживает тяжелые времена, будет подвержена инфляционным процессам. Тогда центробанком такой страны возможно будет принято решение о повышении учетной ставки, что потенциально должно придать валюте большей устойчивости и сделать ее более привлекательной для инвесторов, и таким образом спровоцировать рост обменного курса.

□ Рынки и отрасли. Трейдеры бинарных опционов, которые предпочитают использовать в качестве актива акции или другие подобные инструменты биржевых рынков, должны также обратить внимание на состояние индустрии, к которой принадлежит актив. Во многих случаях, успех компании тесно связан с общим состоянием конкретной отрасли, к которой компания и принадлежит, и потенциально это может повлиять на котировки ее акций. Например, акции компании, которая функционирует в пределах стагнирующей отрасли, скорее всего, будут падать в цене. Однако если конкретная отрасль находится на подъеме, то даже компании переживающие трудные времена могут быть хорошим объектом для инвестиций и принести прибыль в долгосрочной перспективе.

□ Индикаторы. Трейдеры бинарных опционов, которые проводят фундаментальный анализ, также уделяют пристальное внимание публикуемым макроэкономическим индикаторам, поскольку они могут повлиять на цену актива. Опережающие индикаторы начинают изменяться до того как экономика успевает отреагировать. Такие индикаторы могут помочь повысить прибыльность торговых операций. Существуют также еще один тип индикаторов – запаздывающие индикаторы, которые обычно следуют за рыночной динамикой и отображают ситуацию уже после произошедших изменений в экономике. Один из самых известных запаздывающих индикаторов – это уровень безработицы в экономике. Выделяют также третий тип индикаторов – синхронные (совпадающие) индикаторы, которые в среднем изменяются вместе со всей экономикой. К таким индикаторам, например, относится валовой внутренний продукт страны или ВВП.

2 Показатели динамики производственного сектора

С учетом становления системы производственная функция в год характеризуется уравнением, содержащим

определенную зависимость признаков от времени:

Вместе с этими показателями, как капитал, труд и выпуск продукции к ключевым показателям относятся кроме того фонд накопления и фонд пользования. Данные фонды находятся в зависимости от нормы скопления за время. Традиционно рассматривается линейная или же экспоненциальная политическая деятели конфигурации нормы скопления, что имеют вид или

соответственно. Здесь S_0 и h – некоторые постоянные параметры, характеризующие величину нормы накопления.

Фонд накопления равен произведению нормы накопления на значение производственной функции:

Фонд потребления равен разности между значением производственной функции и фондом накопления

К дополнительным показателям относятся:

фондовооруженность труда K_t/L_t ,

производительность труда Y_t/L_t ,

отдача капитала Y_t/K_t ,

среднедушевое потребление C_t/L_t .

Отмеченные ключевые и вспомогательные характеристики на ежегодно предсказуемого периода рассчитываются рекуррентно на базе пропорций, и еще формул для добавочных признаков.

3 Индексы делового оптимизма, особенности анализа

Индексы делового оптимизма рассчитываются на базе субъективного выборочного опроса ведущих предпринимателей (руководителей больших корпораций) о состоянии экономики. Менеджмент фирм наполняет Умышленно созданный опросник, оценивая активность в любой области как усилившуюся, ослабевшую либо не изменившуюся. Для любой подгруппы диффузионный индекс рассчитывается как процентное отношение ответов «усилилась» + половина процентного дела ответов «не изменилась». Композитный индекс рассчитывается как взвешенная с всевозможными коэффициентами сумма индексов по персональным подгруппам. Получившееся количество нормируется с учетом сезонных циклов и праздничков. Используя эти индексы вполне возможно уверенней заглянуть на месяц, 2 либо квартал вперед.

Institute for Supply Management (ISM) до января 2002 г. носил название NAPM – National Association of Purchasing Managers. ISM создан в 1915 г. и соединяет более 45 000 умелых менеджеров. Diffusion Index PMI – Диффузионный индекс ISM по оптовым закупкам (Индекс делового оптимизма). Включает в себя такие эти по СОЕДИНЕННЫХ ШТАТОВ, как: заявки, продукция, занятость, материально-производственные запасы, время поставки, стоимости экспорта и импорта. Единый индекс рассчитывается с учетом пяти индексов:

□ заказы – 30%,

□ продукция – 25%,

□ занятость – 20%,

□ поставки – 15%,

□ материально-производственные запасы – 10%.

ISM Services Index представляет собой результаты опроса менеджеров в сфере услуг с целью оценки изменений, происходящих в этой отрасли. Значение ниже 50 свидетельствует о замедлении темпов развития экономики. Оказывает ограниченное влияние на рынок. Рост значения этого индекса является благоприятным фактором для роста курса доллара.

Индекс промышленных компаний чикагского района. Говорит о подъеме финансовой активности в районе, в случае если его значение превосходит 50, и о урезании, в случае если значение спускается ниже этого уровня. Степень воздействия на рынок: достаточно высочайшая. В одном ряду с индексом ФРБ Филадельфии, применяется при прогнозировании индекса Государственной ассоциации менеджеров по закупкам, который выходит на несколько дней позднее.

Atlanta Fed Index характеризует отношение к текущей экономической ситуации производителей Атланты. Показатель ниже «0» свидетельствует о замедлении темпов развития экономики. Увеличение значения этого индекса является благоприятным фактором для роста курса доллара. Этот индекс оказывает ограниченное влияние на рынок, так как публикуется после выхода индикатора деловой активности на

национальном уровне (ISM index).

Philadelphia Fed Index – индекс общей экономической ситуации в регионе (Пенсильвания, Нью-Джерси и Делавэр). Характеризует отношение производителей Филадельфии к текущей экономической ситуации. Цифры ниже «0» являются индикатором замедления темпов развития экономики. Оказывает ограниченное влияние на рынок, однако может давать представление о том, каким выйдет индикатор деловой активности на национальном уровне. Рост значения этого индекса приводит к росту курса доллара. Индекс APICS – APICS Business Outlook Index. Индекс, основанный на исследовании промышленных предприятий и сигнализирующий о росте экономической активности, если его значение превышает 50, и о снижении, если значение опускается ниже этого уровня. Степень влияния на рынок: низкая. Используется при прогнозировании индекса Национальной ассоциации менеджеров по закупкам, который выходит на несколько дней позже.

4 Система финансовых коэффициентов компании, специфика расчета и применения

Экономические характеристики – это безусловные величины, характеризующие существо и применение денежных ресурсов в экономике страны, ее экономическое положение, эффекты домашней работы предпринимательских структур, уровень заработков населения, распределение и перераспределение валового внутреннего продукта при помощи финансов. Совокупность денежных характеристик делает систему, которая распределяется на сводные и личные характеристики. Сводные характеристики определяют действия и процессы на макроуровне. Персональные – детализируют возведенные и дополняют их.

Показатели ликвидности:

1. Коэффициент абсолютной ликвидности (LR)

Показывает, какая доля краткосрочных долговых обязательств может быть покрыта за счет денежных средств и их эквивалентов в виде рыночных ценных бумаг и депозитов, т.е. практически абсолютно ликвидными активами.

-

Эта часть работы выложена в ознакомительных целях. Если вы хотите получить работу полностью, то приобретите ее воспользовавшись формой заказа на странице с готовой работой:

<https://studservis.ru/gotovye-raboty/otvety-na-bilety/18125>