

# **КУРСОВА РАБОТА**

**BAEB 882D „Анализ на риска“**

**Изготвил:**

**Преподавател:**

**Гр. София**

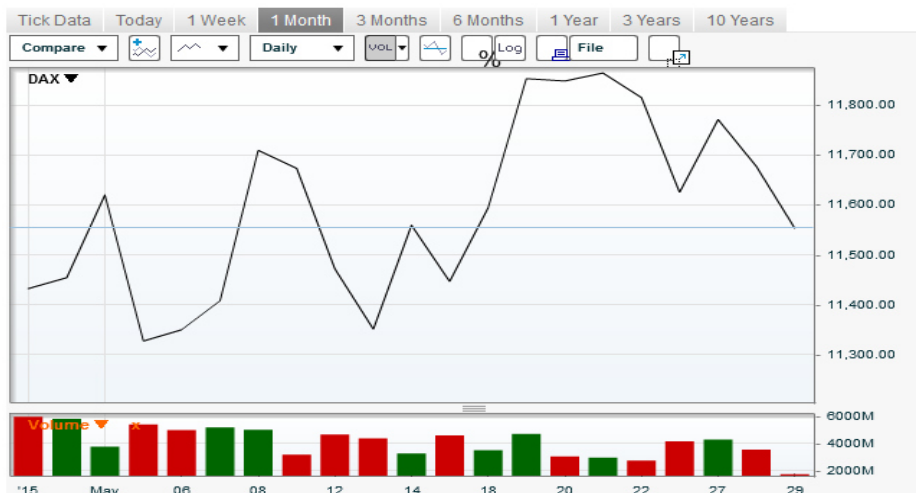
## Първи модул:

Първият индекс е **DAX**. Този индекс осреднява пазарните стойности на 30 най-търгувани акции на борсата във Франкфурд – Германия. По-долу ще представя информация за този индекс за 30 дена назад или за месец 05.2015 година:

### Historical Data

Date	Open	Daily High	Daily Low	Last Value of the day	Daily Traded Units	Daily Turnover
28/05/2015	11,716.10	11,773.80	11,606.00	11,677.57	-	3.54 bn.
27/05/2015	11,647.00	11,790.30	11,595.10	11,771.13	-	4.29 bn.
26/05/2015	11,841.50	11,920.30	11,586.30	11,625.13	-	4.16 bn.
22/05/2015	11,881.50	11,881.80	11,792.30	11,815.01	-	2.71 bn.
21/05/2015	11,815.40	11,868.70	11,758.80	11,864.59	-	2.95 bn.
20/05/2015	11,858.50	11,871.50	11,780.00	11,848.47	-	3.02 bn.
19/05/2015	11,709.90	11,873.30	11,706.80	11,853.33	-	4.72 bn.
18/05/2015	11,464.80	11,595.00	11,378.90	11,594.28	-	3.49 bn.
15/05/2015	11,593.20	11,632.40	11,383.20	11,447.03	-	4.61 bn.
14/05/2015	11,299.20	11,579.80	11,218.50	11,559.82	-	3.25 bn.
13/05/2015	11,533.00	11,596.50	11,301.60	11,351.46	-	4.39 bn.
12/05/2015	11,558.00	11,565.20	11,377.30	11,472.41	-	4.68 bn.
11/05/2015	11,674.50	11,702.10	11,622.00	11,673.35	-	3.16 bn.
08/05/2015	11,483.10	11,710.40	11,415.30	11,709.73	-	5.03 bn.
07/05/2015	11,265.10	11,437.60	11,167.50	11,407.97	-	5.20 bn.
06/05/2015	11,377.60	11,457.90	11,239.90	11,350.15	-	5.02 bn.
05/05/2015	11,576.10	11,751.20	11,322.60	11,327.68	-	5.42 bn.
04/05/2015	11,506.80	11,656.90	11,411.80	11,619.85	-	3.77 bn.

Както се вижда от таблицата по-горе на 04.05 неговата стойност при отварянето е 11 506.80, а на 28.05 вече е 11 716.10, което е повишение. Същото се наблюдава и при цената на затварянето на борсата. Това е приблизително с 3 бина по-високо. Ето я и графиката:



Следващият показател е **Dow Jones**, който е най-известния свързан с тенденцията на финансовия пазар. Неговите компоненти се променят в зависимост от промяната в позициите на едни от най-големите промишлени корпорации в САЩ. Като се вижда от графиката по-долу през първата част от май месец има рязък спад на индекса и това е поради причината, че цените на акциите на APPLE рязко спаднаха, а това е една от най-големите американски компании на борсата. За един месец спрямо предходния (април) цената на този индекс се е променила едва с 0,09%, което е нищожна промяна.



Следващият показател е **NYSE**. Този показател се изчислява на база пазарните стойности на всички корпорации които са регистрирали ценни книжа на Нюйоркската фондова борса. Той представя средната стойност на акциите на всички компании, които търгуват на тази борса. Този показател се измерва в долари, а предходния в пунктове. Подолу ще представя изменението му за 30.04.2015 година.

NYSE	NYSE ARCA	NYSE MKT	INDICES
SYMBOL	VOLUME	LAST PRICE	CHANGE \$ (%)
BAC	74,257,995	\$16.50	-\$0.17 (-1.020%)
PFE	50,082,881	\$34.75	+\$0.31 (+0.900%)
RAD	44,054,016	\$8.72	+\$0.02 (+0.230%)
GE	41,660,034	\$27.27	-\$0.36 (-1.303%)
NLY	37,282,332	\$10.44	+\$0.11 (+1.065%)

Market data delayed 15 min.

NYSE	NYSE ARCA	NYSE MKT	INDICES
SYMBOL	VOLUME	LAST PRICE	CHANGE \$ (%)
UWTI	114,968,610	\$3.54	+\$0.37 (+11.672%)
UGAZ	86,314,062	\$1.93	-\$0.14 (-6.763%)
EEM	59,462,243	\$41.12	-\$0.40 (-0.963%)
VXX	43,897,275	\$19.02	+\$0.14 (+0.742%)
EWJ	40,804,246	\$13.05	-\$0.12 (-0.911%)

Market data delayed 15 min.

NYSE	NYSE ARCA	NYSE MKT	INDICES
SYMBOL	VOLUME	LAST PRICE	CHANGE \$ (%)
GSAT	7,127,974	\$2.65	+\$0.30 (+12.766%)
NGD	5,898,342	\$3.18	+\$0.00 (+0.000%)
ATNM	2,578,848	\$3.94	+\$0.41 (+11.615%)
TXMD	2,342,526	\$7.08	+\$0.35 (+5.201%)
UEC	2,311,789	\$2.99	+\$0.09 (+3.103%)

Market data delayed 15 min.

Следващият показател е **NASDAQ**. Това е сборен индекс от акциите които се търгуват на извънборсовия пазар. Представлява 80% от всички емисии, които се котират на Нюйортската фондова борса. Този индекс се смята за доста сложен, както и по точен от Dow Jones поради причината, че в него са включени стойностите на повече акции и корпорации които търгуват на борсата.

### Stock Market Activity

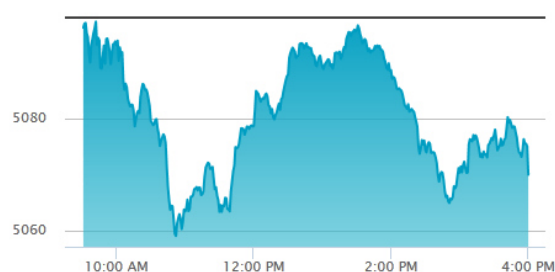
Index	Value	Change Net / %
NASDAQ	5070.03	-27.95 ▼ 0.55%
NASDAQ-100 (NDX)	4508.25	-27.41 ▼ 0.60%
Pre-Market (NDX)	4536.13	0.47 ▲ 0.01%
After Hours (NDX)	4512.30	4.05 ▲ 0.09%
DJIA	18010.68	-115.44 ▼ 0.64%
S&P 500	2107.39	-13.4 ▼ 0.63%
Russell 2000	1246.53	-6.57 ▼ 0.52%

Data as of May 29, 2015

[View Major Indices](#) →

### NASDAQ Composite

Volume: 1,893,837,588



Последният показател, който ще разгледам е **NIKKEI**. Този показател е много стар. Той се публикува за първи път през 1949 година и включва 225 акции от Токийската фондова борса. Изчисляването му става като средна аритметична величина между тези 225 акции. Между този показател и йената съществува правопрпорционална връзка – когато пазара се отваря с високи стойности на този индекс то тогава се вдига и котировката на йената.

Също така има и разновидност на **NIKKEI** това е **NIKKEI 50** като той включва 50 акции на големи корпорации, които едновременно се търгуват на Токийската и Нюйортската фондова борса.