

GLOBAL DERIVATIVES

SIMULADOR DEL MERCADO DE DIVISAS

EL MERCADO

Desarrollo de un mercado "real" de divisas que pueden cotizar en cualquier moneda base

Se pueden operar 3 divisas en forma simultánea y a tiempo real

La divisas se comportan de la misma manera que en el mercado real respetando los parámetros de: volatilidad, operatividad y tamaño de mercado que el supervisor define al inicio de la simulación

El mercado opera por su propia cuenta generando operaciones de compra/venta en tendencias y ciclos que se autodefinen en cada simulación

El mercado opera con posturas de compra y de venta manejando volúmenes individuales para cada tipo de transacción

Simulated Dealing

Configuración

Parámetros definibles solo al inicio de la sesión

Base	Activas	Divisa	Apertura	Volatilidad	Tasa (%)	Volatilidad	Spread	Strike	Strike	Strike
<input type="radio"/>	<input type="checkbox"/>	USD	7.6	50	6	15	.1	7.4	7.6	8
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	Corona sueca								
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	Dólar canadiense								
<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	Dólar E.U.								
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	Florín holandés								
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	Franco belga								
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	Franco francés								
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	Franco suizo								
<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	Libra esterlina								
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	Lira italiana								
<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	Marco alemán								
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	Peseta española								
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	Yen japonés								

Fecha de vencimiento (dd/mm/aaaa) --> 12/12/1996 12/12/1996 12/12/1996

Repetir Fechas

Tasa de interés doméstica en % 33 15 1

Influencia de las noticias en el tiempo y volumen 50

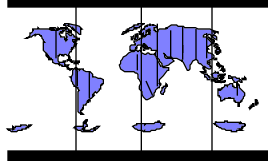
Posición inicial

Límites de operación

Iniciar simulación de respaldo Iniciar simulación

Parámetros dinámicos

Divisa	Operatividad	Volumen Prom. x Oper.	Velocidad del tiempo	Peso de las noticias	Regresar a la simulación
USD	58	6,923	50	25	Terminar simulación
GBP	41	7,692			Terminar programa
DEM	75	3,846			



GLOBAL DERIVATIVES

La velocidad de las transacciones corresponde a la operación de un día normal y el supervisor puede controlar el tiempo haciendo al mercado mas lento o rápido dependiendo del grado de desarrollo que presentan los traders durante el proceso de formación y entrenamiento.

El mercado responde a tres niveles de noticias que se van generando e informando automatizadamente durante el día, donde los traders tienen que aprender a entender la profundidad e influencia de las noticias económicas, políticas y financieras sobre las diferentes divisas

FUNCIONES Y ATRIBUTOS DEL SUPERVISOR

Define la configuración de la simulación:

- Divisas a negociar
- Moneda Base
- Precios iniciales de las divisas

Global Derivatives Simulated Dealing. Operador 01 - supervisor

9:32

Monitor de Divisas

Divisa	Ultimo precio	Variac. Un.
USD	7.6057	.0057
GBP	10.9962	-.0038
DEM	4.9775	-.0225

Op.	Compra	Volumen	Venta	Volumen	Compra	Volumen	Venta	Volumen	Compra	Volumen	Venta	Volumen
01												
00	7.6043	3.211	7.6057*	1.084	10.9610*	6.166	10.9762	9.091	4.9721*	6.624	4.9762	5.875

Monitor de Opciones

Opción	Precio Actual	Valor Teórico	Delta	Gama	Posturas de Compra Precio	Posturas de Compra Volumen	Posturas de Venta Precio	Posturas de Venta Volumen
USD/mxp C 7.4 12/12/96	1.394350	0.994031	0.956189	0.130823	1.394340	13,451	1.395323	3,434
USD/mxp P 7.4 12/12/96	0.478090	0.019256	-0.043811	0.130823	0.477706	3,911	0.478090	12,959
USD/mxp C 7.6 12/12/96	1.287947	0.834981	0.922491	0.204697	1.287160	4,841	1.287698	4,381
USD/mxp P 7.6 12/12/96	0.550365	0.036269	-0.077509	0.204697	0.549997	11,106	0.550422	12,736
USD/mxp C 8. 12/12/96	1.100704	0.550076	0.80					
USD/mxp P 8. 12/12/96								

Colocar posturas de divisas

Divisa	Postura de compra Precio	Postura de compra Volumen	Postura de venta Precio	Postura de venta Volumen
USD	7.6043	20000	7.6057	
GBP	10.9610	1456	10.9762	
DEM	4.9775		4.9811	30000

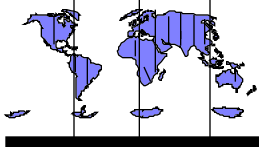
Se muestran las mejores posturas ajenas

Cancelar Procedo

Noticias

09:31 Inglaterra : No consideran atr

rsi macd



GLOBAL DERIVATIVES

Global Derivatives Simulated Dealing. Operador 01 - supervisor

9:34

Parámetros de intervención del mercado

Tendencia: Alza Baja % de cambio por hora (Aprox.) 0

50 % De probabilidad del mercado a:

Comprar Vender

Divisa	Tendencia	% Cambio	% Probab. de:	Activo
USD		0	50	<input type="checkbox"/>
GBP		0	50	<input type="checkbox"/>
DEM		0	50	<input type="checkbox"/>

Aplicar a: **USD** **GBP** **DEM** Estas indicaciones se suman (no substituyen) a la actividad propia del mercado **Proceder**

Parámetros de Banxico

	USD	GBP	DEM
Parámetros de la divisa activos	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>
Compra si el precio es <= a:	7.4	.0000	.0000
Vende si el precio es >= a:	7.8	.0000	.0000
Máxima posición autorizada en largo (+)	1000000	0	0
Máxima posición autorizada en corto (-)	60000	0	0
Posición actual	0.00	0.00	0.00
Volumen promedio de operación	6,923	7,692	3,846

Todas las posiciones se representan en veces el volumen promedio de operación **Proceder**

Compra Volumen	Posturas de venta Precio	Volumen
8,008	1.399147	5,189
13,747	0.478090	1,128
6,774	1.295257	3,017
5,146	0.549244	1,759
3,874	1.104929	6,994
10,661	0.711177	10,171

Imprimir forma Cerrar

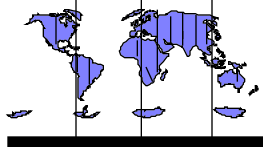
- Posiciones iniciales de los operadores
- Límites de posiciones de los traders
- Operatividad de las divisas
- Volatilidad de las divisas
- Tamaño promedio de la operación del mercado
- Influencia global de las noticias
- Peso específico de las noticias
- Velocidad de la sesión
- El supervisor es también operador

Analiza el comportamiento del mercado y de los traders

- Supervisa cada operación realizada
 - por el mercado
 - por cada trader
 - por cada divisa
 - por cada tipo de operación
- Conoce las posiciones de cada operador
- Conoce si están excediendo límites
- Tiene acceso a un paquete de análisis técnico donde se grafica el comportamiento de las divisas a tiempo real con capacidad de trazo de líneas de tendencias así como generación de 5 tipos distintos de osciladores con parámetros variables.

Controla el Mercado si lo desea mediante:

- Definir parámetros de intervención del Banco de México a



GLOBAL DERIVATIVES

la compra y venta de divisas en sus precios y volúmenes de intervención. Activa la intervención en el momento que desee y los operadores desconocen tanto los parámetros de intervención como el momento ya que el B. M. actúa a través del mercado

- Mover el mercado a su antojo (Mano Negra) definiendo % de incremento o disminución del precio de una divisa en un lapso de tiempo. También los operadores desconocen los % de la manipulación del mercado y del momento que esto ocurra

Tiene acceso a un reporte de tiempo real de todas las transacciones realizadas por el mercado y todos los traders (precio, volumen, tipo y contraparte)

- Por el mercado
- Por todos los traders
- Por trader individual
- Por tipo de operación

Global Derivatives Simulated Dealing. Operador 01 - supervisor

9:36

Límites de operación

Hechos de todo el mercado

Hora	Instrumento	Cant.	Pr. Unit.	Comprador	Vendedor
09:35	DEM/mxd P 6. 12/12/96	5.701	0.835404	Mercado	Mercado
09:35	DEM/mxd C 6. 12/12/96	5.701	0.456239	Mercado	Mercado
09:35	DEM/mxd P 5. 12/12/96	243	0.358314	Mercado	Mercado
09:35	DEM/mxd C 5. 12/12/96	243	0.859917	Mercado	Mercado
09:35	DEM/mxd P 4. 12/12/96	5.701	0.094001	Mercado	Mercado
09:35	DEM/mxd C 4. 12/12/96	243	1.476809	Mercado	Mercado
09:35	GBP/mxd P 12. 12/12/96	243	1.365358	Mercado	Mercado
09:35	GBP/mxd C 12. 12/12/96	5.701	1.230757	Mercado	Mercado
09:35	GBP/mxd P 11. 12/12/96	243	0.903151	Mercado	Mercado
09:35	GBP/mxd C 11. 12/12/96	243	1.652849	Mercado	Mercado
09:35	GBP/mxd P 10. 12/12/96	243	0.544435	Mercado	Mercado
09:35	GBP/mxd C 10. 12/12/96	5.701	2.169571	Mercado	Mercado
09:35	USD/mxd P 8. 12/12/96	243	0.711358	Mercado	Mercado
09:35	USD/mxd C 8. 12/12/96	5.701	1.100844	Mercado	Mercado
09:35	USD/mxd P 7.6 12/12/96	243	0.549390	Mercado	Mercado
09:35	USD/mxd C 7.6 12/12/96	5.701	1.293165	Mercado	Mercado
09:35	USD/mxd P 7.4 12/12/96	5.701	0.477591	Mercado	Mercado
09:35	USD/mxd C 7.4 12/12/96	5.701	1.396967	Mercado	Mercado
09:35	DEM	766	4.961200	Mercado	Mercado
09:35	GBP	208	10.924500	Mercado	Mercado
09:35	USD	8.013	7.615100	Mercado	Mercado
09:35	DEM/mxd P 6. 12/12/96	6.239	0.835404	Mercado	Mercado

Atrás
Adelante
Primero
Ultimo

Divisas

USD

GBP

DEM

MXP

Instrumentos

Divisas

Opciones

Dinero

Operación de:

Compra

Venta

262 Registros

Mostrar

Imprimir ventana

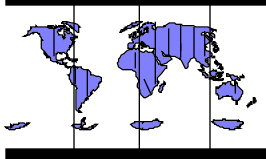
Imprimir hechos

Cerrar

Hechos del:

Mercado

supervisor



GLOBAL DERIVATIVES

- Por divisas
- Participa como trader
 - Puede colocar posturas de compra/venta así como tomar posturas tanto del mercado como de cualquiera de los operadores.
 - Puede cambiar a parámetros de la simulación durante la misma sesión así como hacer pausa de todo el proceso para hacer indicaciones a los traders o descansar reiniciando posteriormente la sesión en el punto exacto donde se detuvo.

TRADERS

Toman posiciones de compra/venta de cualquiera otro operador o del mercado y por el monto deseado (hasta el volumen de las posturas) y siempre y cuando sea suficientemente ágil su decisión de acuerdo con la volatilidad y operatividad de la divisa.

El sistema lleva un análisis a tiempo real de sus posiciones señalándole el tamaño y lado de las mismas, sus límites y la valuación de pérdidas y ganancias.

Colocar posiciones de compra/venta con volúmenes individuales por cada divisa pudiendo cancelarlas antes de que el mercado u otro operador las tome.

Tiene acceso a un reporte a tiempo real de todas sus transacciones

Global Derivatives Simulated Dealing. Operador 01 - supervisor

Monitor de Divisas

	USD		Variac. Un.		GBP		Variac. Un.		DEM		Variac. Un.	
	Ultimo precio				Ultimo precio				Ultimo precio			
	7.6148		.0148		10.9462		-.0538		5.0358			.0358
Op.	Compra	Volumen	Venta	Volumen	Compra	Volumen	Venta	Volumen	Compra	Volumen	Venta	Volumen
01												
00	7.6108 *	13.017	7.6140	10.490	10.9471	3.362	10.9484 *	7.340	5.0593	7.303	5.0613 *	196

Monitor de Opciones

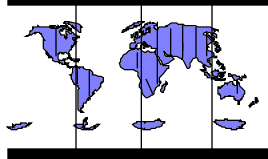
	Precio	Valor	Posturas de Compra		Posturas de Venta	
Decisión	Actual	Teórica	Precio	Volumen	Precio	Volumen

Posición del operador

Divisa	Posición Neta	Precio de Equilibrio	Ultimo Precio	Valor en Pesos
USD	2,217	7.6111	7.6148	16,882.012
Límites:				
GBP	3,804	10.9450	10.9462	41,639.345
Límites:				
DEM	-6,305	4.9629	5.0358	-31,750.719
Límites:				
MXP			Suma	26,770.637
			Caja	-27,217.504
			Utilidad	-446.867

Gráfica de la utilidad en Pesos

Operador 01



GLOBAL DERIVATIVES

realizadas (precio, volumen, tipo y contraparte)

- Con el mercado
- Con otro operador
- Por divisas
- Por tipo de operación

Lo anterior también tiene por objeto confirmar dichas operaciones con sus contrapartes.

Tiene acceso a un paquete de análisis técnico donde se grafica el comportamiento de las divisas a tiempo real con capacidad de trazo de líneas de tendencias así como generación de 5 tipos distintos de osciladores con parámetros variables.

No tiene acceso a las transacciones de los otros operadores ni del mercado

No tiene acceso a los parámetros de la configuración ni las intervenciones de Banco de México o a la manipulación del mercado.

CARACTERISTICAS GENERALES

Sistema en ambiente Windows con operación en RED

Hasta 18 participantes

Control independiente por operador de los colores de precios, posturas, volúmenes y gráficas.

Control independiente por operador del diseño de las pantalla, tamaño de ventanas y parámetros de análisis técnico.

Características especiales del Sistema

El sistema cuenta con 4 años de garantía en su funcionamiento

Los Upgrades se cotizarán por evento.

