

федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение  
высшего образования  
«Тольяттинский государственный университет»

Б1.В.ДВ.02.02

## РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Анализ валютного рынка

*(наименование дисциплины)*

по направлению подготовки (специальности)

38.04.01 Экономика

*(код и наименование направления подготовки, специальности в соответствии с ФГОС ВО)*

«Бизнес-аналитика»

*(направленность (профиль))*

Форма обучения заочная

Год набора: 2018

Распределение часов дисциплины по курсам и видам занятий (по учебному плану)

Количество ЗЕТ	6							
Часов по РУП	216							
Виды контроля на курсах:	Экзамены	Зачеты		Курсовые проекты		Курсовые работы		Контрольные работы (для заочной формы обучения)
	2							
	№№ курса							
	1	2	3	4	5	6	7	Итого
ЗЕТ по курсам		6						6
Лекции		6						6
Лабораторные								
Практические		10						10
Контактная работа		16						16
Сам. работа		191						191
Контроль		9						9
Итого		216						216

Тольятти, 2017

Рабочая программа составлена на основании ФГОС ВО и учебного плана направления подготовки 38.04.01 Экономика

(код и наименование направления подготовки, специальности в соответствии с ФГОС ВО)

**Рецензирование рабочей программы дисциплины:**



Отсутствует



Учебная (рабочая) программа одобрена на заседании кафедры «Финансы и кредит» (протокол заседания № 1 от «05» сентября 2017 г.).



Рецензент

\_\_\_\_\_  
(должность, ученое звание, степень)

«\_\_» \_\_\_\_\_ 20\_\_ г.

\_\_\_\_\_  
(подпись)

\_\_\_\_\_  
(И.О. Фамилия)

**Срок действия рабочей программы дисциплины до «05» сентября 2021 г.**

**Информация об актуализации рабочей программы дисциплины:**

Протокол заседания департамента магистратуры (бизнес-программ) № 1 от «13» августа 2018 г.

Протокол заседания департамента магистратуры (бизнес-программ) № 1 от «30» августа 2019 г.

Протокол заседания департамента магистратуры (бизнес-программ) № 1 от «27» августа 2020 г.

Протокол заседания департамента магистратуры (бизнес-программ) № \_\_ от «\_\_» \_\_\_\_ 20\_\_ г.

УТВЕРЖДАЮ

Заведующий кафедрой «Финансы и кредит»

(разработавшей РПД)

«\_\_» \_\_\_\_\_ 20\_\_ г.

\_\_\_\_\_  
(подпись)

А.А. Курилова

(И.О. Фамилия)

**АННОТАЦИЯ**  
**дисциплины (учебного курса)**  
**Б1.В.ДВ.02.02 Анализ валютного рынка**  
(индекс и наименование дисциплины (учебного курса))

**1. Цель и задачи изучения дисциплины**

Цель – формирование у студентов теоретических знаний и практических навыков в области анализа валютного рынка.

Задачи:

- сформировать у студентов понимание сущности валютного рынка;
- сформировать у студентов практические навыки в области анализа валютного рынка.

**2. Место дисциплины в структуре ОПОП ВО**

Данная дисциплина относится к обязательным дисциплинам вариативной части блока Б.1 направления подготовки 38.04.01 «Экономика».

Для ее освоения требуются знания, умения и навыки, полученные при изучении экономических дисциплин, таких как «Фундаментальный анализ на рынке ценных бумаг», «Обработка и анализ данных (продвинутый уровень)». Желательно владение иностранным языком в объеме, достаточном для чтения зарубежной учебной и научной экономической литературы.

Дисциплины, учебные курсы, для которых необходимы знания, умения, навыки, приобретаемые в результате изучения данной дисциплины –написание научных статей, написание магистерской диссертации (ВКР).

**3. Планируемые результаты обучения по дисциплине, соотнесенные с планируемыми результатами освоения образовательной программы**

<b>Формируемые и контролируемые компетенции</b>	<b>Планируемые результаты обучения</b>
- способность к абстрактному мышлению, анализу, синтезу (ОК-1)	Знать: <ul style="list-style-type: none"><li>- основы валютного рынка</li><li>- основы анализа валютного рынка</li><li>- методы анализа валютного рынка</li></ul>
	Уметь: <ul style="list-style-type: none"><li>- собирать и обрабатывать экономические и социальные данные</li><li>- анализировать валютный рынок</li><li>- применять все инструменты для анализа валютного рынка</li></ul>
	Владеть: <ul style="list-style-type: none"><li>- методами сбора, обработки и анализа экономических и социальных данных</li><li>- методами и приёмами анализа валютного рынка</li><li>- навыками применения всех инструментов для анализа валютного рынка</li></ul>

Формируемые и контролируемые компетенции	Планируемые результаты обучения
<p>- способность готовить аналитические материалы для оценки мероприятий в области экономической политики и принятия стратегических решений на микро- и макроуровне (ПК-8)</p>	<p>Знать:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- базовые основы подготовки аналитических материалов для оценки мероприятий в области анализа валютного рынка</li> <li>- основы подготовки аналитических материалов для оценки мероприятий в области анализа валютного рынка</li> <li>- особенности подготовки аналитических материалов для оценки мероприятий в области анализа валютного рынка</li> <li>- все существующие методики проведения анализа валютного рынка</li> </ul>
	<p>Уметь:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- готовить аналитические материалы для оценки мероприятий в области анализа валютного рынка, анализировать и интерпретировать их</li> <li>- проводить всесторонний анализ валютного рынка</li> <li>- выбирать инструментальные средства для обработки данных о состоянии валютного рынка</li> </ul>
	<p>Владеть:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- навыками подготовки аналитических материалов для оценки мероприятий в области анализа валютного рынка, их анализа и интерпретации</li> <li>- навыками проведения анализа валютного рынка</li> <li>- навыками выбора инструментальных средств для обработки данных о состоянии валютного рынка</li> </ul>
<p>- способность составлять прогноз основных социально-экономических показателей деятельности предприятия, отрасли, региона и экономики в целом (ПК-10)</p>	<p>Знать:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- особенности составления прогноза валютного рынка с учетом изменения социально-экономических показателей экономики в целом</li> <li>- основы составления прогноза валютного рынка с учетом изменения социально-экономических показателей экономики в целом</li> <li>- социально-экономические показатели валютного рынка</li> </ul>
	<p>Уметь:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- составлять прогнозы валютного рынка с учетом изменения социально-экономических показателей экономики в целом, анализировать и интерпретировать их</li> <li>- составлять прогнозы валютного рынка с учетом изменения социально-экономических показателей экономики в целом</li> <li>- находить социально-экономические показатели валютного рынка</li> </ul>
	<p>Владеть:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- навыками составления прогнозов валютного рынка с учетом изменения социально-экономических показателей</li> </ul>

Формируемые и контролируемые компетенции	Планируемые результаты обучения
	<p>экономики в целом, анализировать и интерпретировать их</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- навыками составления прогнозов валютного рынка с учетом изменения социально-экономических показателей экономики в целом</li> <li>- навыками поиска социально-экономических показателей валютного рынка</li> </ul>

**Общая трудоемкость дисциплины – 6 ЗЕТ.**

**Структура и содержание дисциплины Анализ валютного рынка**  
**Курс изучения 2**

модуль/Раздел,	Подраздел, тема	Виды учебной работы							Необходимые материально-технические ресурсы	Формы текущего контроля	Рекомендуемая литература (№)
		Контактная работа (в часах)					Самостоятельная работа				
		всего			в т.ч. в интерактивной форме	Формы проведения лекций, лабораторных, практических занятий, методы обучения, реализующие применяемую образовательную технологию	в часах	формы организации самостоятельной работы			
		лекций	лабораторных	практических							
Анализ валютного рынка	1. Валютный курс и факторы, влияющие на его формирование	1		2	2	Аудио-/видео- лекции электронного учебника с консультацией преподавателя на форуме	50	Самостоятельное выполнение практических заданий, контроль смены IP-адресов, анализ текущей успеваемости при помощи БРС-рейтинга	LMS-система на основе Moodle, компьютер либо планшет либо смартфон	Промежуточный тест Итоговое тестирование	1-5
	2. Биржевой валютный рынок. Межбанковский валютный рынок. Рынок срочных операций	1		2	2	Аудио-/видео- лекции электронного учебника с консультацией преподавателя на форуме	50	Самостоятельное выполнение практических заданий, контроль смены IP-адресов, анализ текущей успеваемости при помощи БРС-рейтинга	LMS-система на основе Moodle, компьютер либо планшет либо смартфон	Промежуточный тест Задание 1 Итоговое тестирование	1-5
	3. Закономерности	2		2	4	Аудио-/видео- лекции	50	Самостоятельное	LMS-система на	Промежу	1-5

модульРаздел,	Подраздел, тема	Виды учебной работы							Необходимые материально-технические ресурсы	Формы текущего контроля	Рекоменд уемая литератур а (№)
		Контактная работа (в часах)					Самостоятельная работа				
		всего			активной форме	Формы проведения лекций, лабораторных, практических занятий, методы обучения, реализующие применяемую образовательную	в часах	формы организации самостоятельной работы			
		лекций	хлабораторны	практических							
	функционирования спотового и срочного валютного рынка и валютной биржи					электронного учебника с консультацией преподавателя на форуме		выполнение практических заданий, контроль смены IP-адресов, анализ текущей успеваемости при помощи БРС-рейтинга	основе Moodle, компьютер либо планшет либо смартфон	точный тест Задание 2 Итоговое тестирова ние	
	4. Способы анализа и обработки данных по операциям на валютном рынке (спотовом и срочном)	2		4	6	Аудио-/видео- лекции электронного учебника с консультацией преподавателя на форуме	41	Самостоятельное выполнение практических заданий, контроль смены IP-адресов, анализ текущей успеваемости при помощи БРС-рейтинга	LMS-система на основе Moodle, компьютер либо планшет либо смартфон	Промежу точный тест Задание 3 Итоговое тестирова ние	1-5
	Контроль:						9				
Итого:		6		10	16		191				
		16						216			

## 5. Критерии и нормы текущего контроля и промежуточной аттестации

Формы текущего контроля	Услови я допуск а	Критерии и нормы оценки
Задание 1	Отсутс твуют	4 балла – задание выполнено в полном объёме согласно инструкции, сделаны выводы 3 балла – задание выполнено в полном объёме согласно инструкции, отсутствуют выводы 2 балла – задание выполнено не в полном объёме, есть незначительные замечания 1 балла – задание выполнено не в полном объёме, присутствуют существенные замечания 0 баллов – задание не выполнено
Задание 2	Отсутс твуют	5 баллов – задание выполнено в полном объёме согласно инструкции, сделаны выводы 4 балла – задание выполнено в полном объёме согласно инструкции, отсутствуют выводы 2-3 балла – задание выполнено не в полном объёме, есть незначительные замечания 1 балл – задание выполнено не в полном объёме, присутствуют существенные замечания 0 баллов – задание не выполнено
Задание 3	Отсутс твуют	4 балла – задание выполнено в полном объёме согласно инструкции, сделаны выводы 3 балла – задание выполнено в полном объёме согласно инструкции, отсутствуют выводы 2 балла – задание выполнено не в полном объёме, есть незначительные замечания 1 балла – задание выполнено не в полном объёме, присутствуют существенные замечания 0 баллов – задание не выполнено
Промежуточный тест	Отсутс твуют	Максимальное количество баллов – 44 б. (баллы студенту начисляются автоматически пропорционально выполненным тестовым заданиям)
Заполненная анкета	Отсутс твуют	3 балла – анкета заполнена 0 – анкета не заполнена
Итоговое тестирование	Отсутс твуют	Максимальное количество баллов - 40 б. (система выдаёт 30 случайных вопросов из банка тестовых заданий; баллы студенту начисляются автоматически пропорционально выполненным тестовым заданиям)
Итого		Максимальное количество баллов – 100 б.

Форма проведения промежуточной аттестации	Условия допуска	Критерии и нормы оценки	
Экзамен (по накопительному рейтингу)	Выполнение всех учебных мероприятий	«отлично»	Студент набрал 80 и более баллов по накопительному рейтингу
		«хорошо»	Студент набрал от 60 до 79 баллов по накопительному рейтингу
		«удовлетворительно»	Студент набрал от 40 до 59 баллов по накопительному рейтингу



Форма проведения промежуточной аттестации	Условия допуска	Критерии и нормы оценки	
		«неудовлетворительно»	Студент набрал 39 и менее баллов по накопительному рейтингу

## 6. Критерии и нормы оценки курсовых работ

Не предусмотрено учебным планом.

## 7. Примерная тематика рефератов

Не предусмотрено учебным планом.

## 8. Вопросы к экзамену

№ п/п	Вопрос
1	Валюта и валютные ценности
2	Конвертируемость валют: понятие, виды, условия
3	Валютная система: понятие, виды
4	Международная валютная система: основы, функции, основные элементы
5	Национальная валютная система, европейская валютная система
6	Валютные операции, классификация валютных операций
7	Порядок регулирования валютных операций
8	Техника проведения и порядок оформления валютных операций
9	Валютные операции резидентов и нерезидентов
10	Валютные операции физических лиц и юридических лиц
11	Понятие и функции валютного рынка
12	Регулирование валютного рынка
13	Классификация валютного рынка
14	Понятие «биржа» и «биржевая деятельность»
15	Эволюция видов и типов бирж
16	Функции современной валютной биржи
17	Понятие, состав и принципы регулирования биржевой деятельности
18	Биржевые поручения и их использование в торговых стратегиях. Основные виды биржевых поручений
19	Виды биржевых цен и особенности их формирования
20	Сущность и значение биржевой котировки цен
21	Принципы и методы котировки цен на бирже
22	Рыночный биржевой валютный курс, сферы его использования коммерческими организациями и уполномоченными банками в РФ
23	Особенности биржевой валютной торговли
24	Порядок торговли валютами на рынке FOREX
25	Виды котировок валют и основные формы сделок на рынке FOREX
26	ММББ: функции, операции, новые сферы деятельности
27	Методы и формы валютного контроля за биржевыми валютными операциями и сделками
28	Понятие, цели и инструменты фундаментального анализа
29	Анализ валютного рынка: сущность, цели, виды
30	Факторы фундаментального анализа
31	Понятие технического анализа и его методы
32	Соотношение и взаимосвязь фундаментального и технического анализа.
33	Понятие тренда в техническом анализе
34	Классические фигуры технического анализа
35	Валютный контроль экспорта и валютных расчетов по экспорту
36	Валютный контроль импорта и валютных платежей по импорту
37	Валютные и курсовые риски во внешнеэкономической (внешнеторговой) деятельности, базовые методы их страхования и хеджирования
38	Реализация текущего валютного контроля в уполномоченном коммерческом банке, на таможне
39	Валюта цены торгового контракта, валюта конечного платежа по торговому контракту, валюта окончательных межбанковских расчетов по торговому контракту, ключевая валюта торгового контакта и сферы их обязательного применения
40	Мировая валюта SDR (XDR), расчет ее цены, сферы использования в РФ
41	Валютообменные и конверсионные операции, транзакции и сделки
42	Свободно используемая валюта и свободно-конвертируемая валюта ее виды, краткая характеристика

№ п/п	Вопрос
	и сферы применения
43	Твердая валюта, резервная валюта, якорная валюта: их состав, краткая характеристика и функциональные особенности
44	Правила использования замкнутой необратимой неконвертируемой валюты
45	Клиринговая валюта. Специфика и основные виды клиринговых расчетов и платежей. Виды клиринга. Валюта баланса.
46	Основные виды валютных ценностей и операции с ними в коммерческих организациях и уполномоченных коммерческих банках
47	Валютный контроль и таможенный надзор за операциями со средствами в наличных банкнотах (в российских рублях — RUR и иностранной твердой валютой), и с золотом (в монетах и слитках)
48	Неторговые валютные операции
49	Кассовые валютные операции
50	Срочные форвардные валютные операции и контракты
51	Методы ранжирования срочных форвардных валютных операций и контрактов, их классификации и контроля
52	Валютные союзы и зоны совместной эмиссии
53	Полный квалификационный статус конкретной иностранной валюты на текущий год
54	Обратимость, режим регулирования и корректировки плавающего курса, эмиссионный режим основных мировых валют
55	Валютный контроль иностранных инвестиций
56	Прямые промышленные, портфельные инвестиции
57	Иностранные инвестиции, зарубежные инвестиции
58	Транзитные инвалютные накопительные счета переходящих сумм в уполномоченном банке в РФ, их специфика и режим
59	Виды, типы и режим инвалютных счетов коммерческого предприятия (организации) в коммерческих банках-резидентах РФ
60	Межбанковский валютный рынок
61	Рынок срочных операций
62	Закономерности функционирования спотового и срочного валютного рынка и валютной биржи
63	Способы анализа и обработки данных по операциям на валютном рынке (спотовом и срочном)

## 9. Фонд оценочных средств для проведения промежуточной промежуточный аттестации обучающихся по дисциплине

### 9.1. Паспорт фонда оценочных средств

№ п/п	Контролируемые разделы (темы) дисциплины	Код контролируемой компетенции (или ее части)	Наименование оценочного средства
1	Валютный курс и факторы, влияющие на его формирование	ОК-1, ПК-8, ПК-10	Промежуточный тест Итоговое тестирование
2	Биржевой валютный рынок. Межбанковский валютный рынок. Рынок срочных операций	ОК-1, ПК-8, ПК-10	Промежуточный тест Задание 1 Итоговое тестирование
3	Закономерности функционирования спотового и срочного валютного рынка и валютной биржи	ОК-1, ПК-8, ПК-10	Промежуточный тест Задание 2 Итоговое тестирование
4	Способы анализа и обработки данных по операциям на валютном рынке (спотовом и срочном)	ОК-1, ПК-8, ПК-10	Промежуточный тест Задание 3 Итоговое тестирование

### 9.2. Типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций в процессе освоения образовательной программы

## 9.2.1. Примерные тесты к Промежуточному тесту и итоговому тестированию

### К теме 1.

1. Валютный курс – это (выберите верный ответ):
  - цена денежной единицы страны, выраженная в золоте;
  - цена денежной единицы страны, выраженная в денежной единице другой страны;
  - цена денежной единицы страны, выраженная в долларах США;
  - относительная цена валют;
  - относительная цена товаров, произведенных в двух странах.
2. Валютный курс определяется следующими факторами:
  - уровнем процентных ставок - повышение процентной ставки стимулирует приток иностранных капиталов, а ее снижение поощряет отток капиталов, в том числе национальных, за границу;
  - состоянием торгового баланса страны;
  - паритетом покупательной способности валют;
  - ожиданиями участников валютного рынка;
  - все ответы верны.
3. Цена денежной единицы одной страны, выраженная в иностранных денежных единицах или международных валютных единицах это:
  - паритет покупательной способности валюты
  - валютный курс
  - режим валютного курса
  - платежный баланс
4. Валютная корзина предполагает по отношению к определенному набору других валют соизмерять:
  - среднеарифметический курс одной валюты
  - среднегеометрический курс одной валюты
  - среднеквадратичный курс одной валюты
  - средневзвешенный курс одной валюты
5. Чем выше темп инфляции в стране, при неизменном состоянии иных факторов, тем:
  - выше курс ее валюты
  - ниже курс ее валюты
  - неизменное остается курс ее валюты
  - нет правильного ответа
6. Активный платежный баланс способствует:
  - повышению курса национальной валюты
  - понижению курса национальной валюты
  - неизменности курса национальной валюты
  - нет правильного ответа
7. Пассивный платежный баланс способствует:
  - повышению курса национальной валюты
  - понижению курса национальной валюты
  - неизменности курса национальной валюты
  - нет правильного ответа
8. Положения теории паритета покупательной способности гласят, что валютный курс определяется относительной стоимостью денег двух стран, которая зависит от:
  - состояния экономики
  - проводимой валютной политики
  - уровня цен
  - ВВП

9. Метод воздействия на курс национальной валюты путем купли-продажи государственными органами иностранной валюты носит название:

- дисконтная (учетная) политика
- девизная политика
- диверсификация валютных резервов
- ревальвация

10. В целях повышения курса национальной валюты Центральный банк в обмен на национальную валюту:

- продает иностранную
- покупает иностранную
- продает золото
- покупает золото

**К теме 2.**

1. Какого индекса Доу-Джонса не существует?

Промышленный индекс Доу-Джонса;

Финансовый индекс Доу-Джонса;

Транспортный индекс Доу-Джонса;

Коммунальный индекс Доу-Джонса.

2. Как называется Центральный Банк Евросоюза?

ЕЦБ;

СФР;

ЦБЕ;

ФРС.

3. Участники рынка, которые заинтересованы в понижении стоимости валюты, называются:

Совы;

Медведи;

Зайцы;

Быки.

4. Первоначальная форма биржевой торговли:

валютно - вексельная

бартерная

фьючерсная

товарная

5. Основные черты биржевой торговли:

регулярность торговли в строго определенном месте

унификация основных требований к качеству товара

заключение сделок с поставкой товара, как со склада, так и в будущем

спонтанность торговли

стандартизированность цены на товары

6. Порядок проведения торговли на товарной бирже:

в форме гласных публичных торгов

в заранее определенном месте

в определенное время

вовремя, в которое может присутствовать как продавец, так и покупатель

в форме, определяемой учредителями биржи

в промежутки с 11 до 17 часов

7. Характеристики открытой биржи:

в торгах имеют право участвовать постоянные члены, биржевые посредники (брокеры и дилеры)

в торгах принимают участие только постоянные члены, выполняющие роль биржевых посредников

в операционный зал биржи доступ непосредственных покупателей и продавцов закрыт

Регулирование биржевой деятельности

8. Межбанковский валютный рынок выполняет следующие основные функции:

обслуживание международного оборота товаров, услуг и капиталов;

формирование валютного курса на основе спроса и предложения на валюту;

хеджирование (страхование) от валютных и кредитных рисков;

проведение денежно-кредитной политики;

получение прибыли в виде разницы курсов валют и процентных ставок по

различным долговым обязательствам;

все ответы верны.

9. Основными парами на межбанковском валютном рынке являются:

EUR/USD

GBP/USD

USD/CHF

USD/JPY

Все ответы верные

10. Кросс- парами на межбанковском валютном рынке являются:

EUR/JPY

EUR/GBP

GBP/CHF

GBP/JPY

Все ответы верные

**К теме 3.**

1. К особенностям спотового рынка относятся:

Осуществление операций купли/продажи актива и расчетов по ним в течение

максимум двух рабочих дней;

Существенно большая степень волатильности активов, нежели на срочном рынке;

Отсутствие процентной ставки на стоимость поставленного актива;

Твердые курсы валют и прочих активов;

Осуществление большей части операций в электронном режиме, с подтверждением транзакций через авизо (электронные извещения);

Все ответы верные

1. К общим чертам спот и срочного рынка относятся:

Рыночные отношения в обоих случаях строятся на классических законах рыночной экономики. Это проявляется в принципах ценообразования, конкурентной борьбе и т.д.;

Государство контролирует участников обоих рынков по одним и тем же документам, и нормативным актам;

Общая инфраструктура рынков, которая проявляется в одинаковых финансовых институтах и технических средствах, обслуживающих субъектов рыночной деятельности;

Все ответы верные.

2. Рынок наличных сделок, предполагающих немедленную оплату по текущей цене. То есть, покупая, к примеру, акцию или один баррель нефти на спотовом рынке, заключение сделки и «обмен» товара (одной акции или одного барреля нефти) на деньги происходит незамедлительно – это:

Спот рынок

Срочный рынок

Кросс-рынок

3. Совокупность всех видов сделок, реализация по которым производится по истечении определенного промежутка времени –это:

Спот рынок

Срочный рынок

Кросс-рынок

4. Котировка валюты, при которой прибыль образуется от операций купли-продажи иностранной валюты в виде курсовой разницы:
  - рыночная
  - официальная
5. Котировка спот, при которой единица национальной валюты приравнивается к определенному количеству иностранной валюты:
  - прямая
  - косвенная
6. Если курс по срочной сделке выше курса наличной валюты, то соответствующая разница с наличным курсом называется:
  - дисконтом
  - премией
7. Чтобы рассчитать кросс-курс для валют с косвенными котировками к доллару США необходимо:
  - перемножить долларовые курсы этих валют;
  - разделить долларовые курсы этих валют;
  - вычесть долларовые курсы этих валют.
8. При расчете кросс-курса для валют с прямой и косвенной котировками к доллару США следует:
  - перемножить долларовые курсы этих валют;
  - разделить долларовые курсы этих валют;
  - вычесть долларовые курсы этих валют.

**К теме 4.**

1. В случае равенства активов и пассивов в иностранной валюте валютная позиция считается:
  - Закрытой
  - Открытой
2. Валюта, относительно которой котируются другие валюты, называется:
  - Базовой
  - Основной
3. Валютная позиция бывает:
  - Открытой
  - Закрытой
  - Базовой
  - Короткой
4. Валютная позиция представляет собой у оператора валютного рынка:
  - соотношение требований и обязательств по той или иной валюте
  - соотношение требований и обязательств по одной валюте
5. Валютный опцион, при котором продавец может отказаться от продажи валюты, называется:
  - опционом продавца
  - опционом покупателя
6. Валютный опцион, при котором покупатель имеет право отказаться от приема валюты, называется:
  - опционом покупателя
  - опционом продавца
7. Валютные операции, направленные на получение прибыли путем сделок с несколькими валютами, называются: конверсионным арбитражем
  - временным арбитражем
8. Валютные операции, направленные на получение прибыли за счет колебаний курса в течение определенного периода времени, называются:

временным арбитражем  
конверсионным арбитражем

9. В тех случаях, когда государство берет на себя ответственность за погашение займов и других обязательств, взятых физическими или юридическими лицами, оно выступает в качестве:

гаранта  
кредитора

10. В развитой рыночной экономике большинство валютных сделок осуществляется на валютном рынке:

межбанковском  
национальном

### Критерии оценки:

Формы текущего контроля	Условия допуска	Критерии и нормы оценки
Промежуточный тест	Отсутствуют	Максимальное количество баллов – 44 б. (баллы студенту начисляются автоматически пропорционально выполненным тестовым заданиям)
Итоговое тестирование	Отсутствуют	Максимальное количество баллов - 40 б. (система выдаёт 30 случайных вопросов из банка тестовых заданий; баллы студенту начисляются автоматически пропорционально выполненным тестовым заданиям)

### Задание 1

**Необходимо:** используя материалы электронного учебника, а также дополнительные материалы, *дать характеристику*:

- 1) Парижской мировой валютной системы;
- 2) Генуэзской мировой валютной системы;
- 3) Бреттон-Вудской валютной системы;
- 4) Ямайской международной валютной системы. Рекомендации по

выполнению задания 1

Изложение должно носить четкий характер. При этом необходимо выделить из текста учебного материала или нормативно-правового акта (если он использовался) основные моменты и изложить обобщенно, своими словами. НЕ следует переписывать текст учебника или текст нормативно-правового акта.

Результат выполнения задания свести в таблицу, которая размещена в бланке выполнения задания 1.

Таблицу рекомендуется располагать в альбомном формате.

В таблице использовать шрифт Times New Roman; 12 размер; 1,0 интервал.

Обязательно давать ссылку на использованный источник.



На основании анализа мировых валютных систем сделайте выводы о причинах и последствиях эволюции систем.

Выводы обоснуйте.

## Бланк выполнения задания 1

Таблица 1

### Сравнительная характеристика мировых валютных систем

Наименование системы	Годы функционирования	Основа	Характеристика системы	Ссылка на использованный источник
1	2	3	4	5
Парижская мировая валютная система				
Генуэзская мировая валютная система				
Бреттон-Вудская валютная система				
Ямайская международная валютная система				
<b>Выводы по заданию 1</b>				

Критерии оценки:

4 балла – задание выполнено в полном объёме согласно инструкции, сделаны выводы

3 балла – задание выполнено в полном объёме согласно инструкции, отсутствуют выводы

2 балла – задание выполнено не в полном объёме, есть незначительные замечания

1 балла – задание выполнено не в полном объёме, присутствуют существенные замечания

0 баллов – задание не выполнено

### Задание 2

**Необходимо:** используя материалы электронного учебника, а также дополнительные материалы, *дать характеристику* следующих валютных рынков:

- международные валютные рынки;
- национальные валютные рынки;
- региональные валютные рынки ;
- биржевые валютные рынки;
- внебиржевые валютные рынки.

### Рекомендации по выполнению задания 2

Изложение должно носить четкий характер. При этом необходимо выделить из текста учебной литературы, учебника или нормативно-правового акта (если он использовался) основные моменты и изложить обобщенно, своими словами. НЕ следует переписывать текст учебной литературы или нормативно-правового акта.

Обязательно давать ссылку на использованный источник.

Результат выполнения задания свести в таблицу, которая размещена в бланке выполнения задания 2.

Таблицу рекомендуется располагать в альбомном формате.

В таблице использовать шрифт Times New Roman; 12 размер; 1,0 интервал.

На основании анализа видов валютных рынков **сделайте выводы** о достоинствах и недостатках каждого вида рынка для торгов.

На основании анализа достоинств и недостатков видов валютных рынков **сделайте общий вывод**.

Выводы обоснуйте.

**Критерии оценки:**

5 баллов – задание выполнено в полном объёме согласно инструкции, сделаны выводы

4 балла – задание выполнено в полном объёме согласно инструкции, отсутствуют выводы

2-3 балла – задание выполнено не в полном объёме, есть незначительные замечания

1 балл – задание выполнено не в полном объёме, присутствуют существенные замечания

0 баллов – задание не выполнено



## Бланк выполнения задания 2

Таблица 2

Сравнительная характеристика видов валютных рынков

Наименование валютного рынка	Сфера функционирован ия	Основа	Характеристика рынка	Достоинства рынка	Недостатки рынка	Ссылка на использованный источник
1	2	3	4	5	6	7
Международные валютные рынки						
Национальные валютные рынки						
Региональные валютные рынки						
Биржевые валютные рынки						
Внебиржевые валютные рынки						
<b>Выводы по заданию 2</b>						

### Задание 3

**А) Данные:** организация планирует обменять канадские доллары на швейцарские франки. На день проведения операции курсы валют (покупка/продажа) были следующими (цифры условные):

- └ канадский доллар/рубль – 46,0901/46,4794;
- └ швейцарский франк/рубль – 59,6547/59,9113.

**Необходимо:** *определить кросс-курс валют* при обмене канадских долларов на швейцарские франки на день совершения операции. Решение обосновать.

**б)**

**Данные:** Центральный банк РФ установил 9 января текущего года курсы иностранных валют: доллар США, евро, российский рубль.

Курсы валют ЦБ РФ на 9 января текущего года (все данные условные):

- └ EUR = 10800,00;
- └ USD = 8450,00;
- └ RUB = 261,00.

Курсы валют ЦБ РФ на 19 января текущего года:

- └ EUR = 10700,00;
- └ USD = 8370,00;
- └ RUB = 265,00.

**Необходимо:**

#### **1. Определить кросс-курс:**

- а) доллара США к евро;
- б) доллара США к российскому рублю;
- в) евро к российскому рублю.

**2. Определить изменение кросс-курса указанных валют** через 10 дней от даты расчета в процентах.

### Рекомендации по выполнению задания 3

Необходимо *произвести расчёты* (все расчеты приводятся в таблице), *сделать все пояснения* к решению и *сделать соответствующие развернутые выводы*.

Сделать *обобщающий вывод* по теме.

Результат выполнения задания свести в таблицу, которая размещена в бланке выполнения задания 3.

Таблицу рекомендуется располагать в альбомном формате.

В таблице использовать шрифт Times New Roman; 12 размер; 1,0 интервал.

Обязательно давать ссылку на использованный источник.

### Бланк выполнения задания 3

Таблица 3

Решение задач по теме «Валютный курс и валютная политика»

Показатель	Формула расчета	Расчет	Пояснения, ссылка на источник
<b>а</b>			
1.	1.	1.	1.
2.	2.	2.	2.
3.	3.	3.	3.
.....	.....	.....	.....
.....	.....	.....	.....
Вывод по заданию 3.1:			
<b>б</b>			
1.	1.	1.	1.
2.	2.	2.	2.
3.	3.	3.	3.
.....	.....	.....	.....
.....	.....	.....	.....
Вывод по заданию 3.2:			
<b>Общий вывод по теме:</b>			

**Критерии оценки:**

- 4 балла – задание выполнено в полном объеме согласно инструкции, сделаны выводы
- 3 балла – задание выполнено в полном объеме согласно инструкции, отсутствуют выводы
- 2 балла – задание выполнено не в полном объеме, есть незначительные замечания
- 1 балла – задание выполнено не в полном объеме, присутствуют существенные замечания
- 0 баллов – задание не выполнено



#### **10. Образовательные технологии и методические указания по освоению дисциплины**

При изучении дисциплины (учебного курса) используются дистанционные образовательные технологии.

## 11. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

### 11.1. Обязательная литература

№ п/п	Библиографическое описание	Тип (учебник, учебное пособие, учебно- методическое пособие, практикум, др.)	Количество в библиотеке
1	Никитинская Ю. В. Международные расчеты и валютные операции [Электронный ресурс] : учеб. пособие / Ю. В. Никитинская, Т. В. Нечаева. - Москва : Вузовский учебник : ИНФРА-М, 2020. - 215 с. - ISBN 978-5-9558-0519-1.	Учеб. пособие	ЭБС «ZNANIUM.COM»
2	Гусаков Н. П. Международные валютно-кредитные отношения [Электронный ресурс] : учебник / Н. П. Гусаков, И. Н. Белова, М. А. Стренина ; под общ. ред. Н. П. Гусакова. - 3-е изд., перераб. и доп. - Москва : ИНФРА-М, 2019. - 351 с. - (Высшее образование. Магистратура). - ISBN 978-5-16-012234-2.	Учебник	ЭБС «ZNANIUM.COM»
3	Авагян Г. Л. Международные валютно-кредитные отношения [Электронный ресурс] : учебник / Г. Л. Авагян, Ю. Г. Вешкин. - 2-е изд., перераб. и доп. - Москва : Магистр : ИНФРА-М, 2016. - 704 с. - ISBN 978-5-9776-0168-9.	Учебник	ЭБС «ZNANIUM.COM»
4	Бродский Б. Е. Макроэкономика [Электронный ресурс] : продвинутый уровень : курс лекций / Б. Е. Бродский. - Москва : Магистр : ИНФРА-М, 2019. - 336 с. - ISBN 978-5-9776-0223-5.	Курс лекций	ЭБС «ZNANIUM.COM»
5	Макроэкономика [Электронный ресурс] : пособие для семинарских занятий / под ред. Р. М. Нуреева. - Москва : Норма : ИНФРА-М, 2017. - 384 с. - ISBN 978-5-91768-788-9.	Пособие для семинарских занятий	ЭБС «ZNANIUM.COM»

### 11.2. Дополнительная литература и учебные материалы (аудио-, видеопособия и др.)

- фонд научной библиотеки ТГУ:

№ п/п	Библиографическое описание	Тип (учебник, учебное пособие, учебно-методическое пособие, практикум, аудио-, видеопособия и др.)	Количество в библиотеке
1	Валютное право [Электронный ресурс] : учеб. пособие / [отв. ред. Ю. М. Литвинова]. - Саратов : Вузовское образование, 2014. - 103 с. - (Высшее образование).	Учеб. пособие	ЭБС «IPRbooks»

- другие фонды:

№ п/п	Библиографическое описание	Тип (учебник, учебное пособие, учебно-методическое пособие, практикум, аудио-, видеопособия и др.)	Место хранения (методический кабинет кафедры, городские библиотеки и др.)
1	Анализ валютного рынка : электронный контент - Тольятти: Изд-во ТГУ. - образовательная среда Росдистант, 2017	Электронное издание	образовательная среда Росдистант

СОГЛАСОВАНО

Директор научной библиотеки \_\_\_\_\_

А. М. Асаева

«\_\_\_» \_\_\_\_\_ 20\_\_ г.

МП

### 12.3. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»

- WebofScience[Электронный ресурс] : мультидисциплинарная реферативная база данных. – Philadelphia: ClarivateAnalytics, 2016– . – Режим доступа : apps.webofknowledge.com. – Загл. с экрана. – Яз. рус., англ.
- Scopus[Электронный ресурс] : реферативная база данных. – Netherlands: Elsevier, 2004– . – Режим доступа : scopus.com. – Загл. с экрана. – Яз. рус., англ.

- Elibrary[Электронный ресурс] : научная электронная библиотека. – Москва : НЭБ, 2000– . – Режим доступа : [elibrary.ru](http://elibrary.ru). – Загл. с экрана. – Яз. рус., англ.
- SpringerLink[Электронный ресурс] : [база данных]. – Switzerland: SpringerNature, 1842– . – Режим доступа : [link.springer.com](http://link.springer.com). – Загл. с экрана. – Яз. англ.
- ScienceDirect[Электронный ресурс] : коллекция электронных книг издательства Elsevier. – Netherlands: Elsevier, 2018– . – Режим доступа : [sciencedirect.com](http://sciencedirect.com). – Загл. с экрана. – Яз. англ.
- Cambridgeuniversitypress[Электронный ресурс] : журналы издательства. – Cambridge: Cambridgeuniversitypress, 2018– . – Режим доступа : [cambridge.org](http://cambridge.org). – Загл. с экрана. – Яз. англ.
- NEICON[Электронный ресурс] : электронная информация : архив научных журналов. – Москва : НЭИКОН, 2002– . – Режим доступа : [neicon.ru/resources/archive](http://neicon.ru/resources/archive). – Загл. с экрана. – Яз. рус., англ.

#### 11.4. Перечень программного обеспечения

№ п/п	Наименование ПО	Количество лицензий	Реквизиты договора (дата, номер, срок действия)
1	Office Standart	1398	Бессрочная
2	Windows	1398	Бессрочная

#### 11.5. Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине

№ п/п	Наименование оборудованных учебных кабинетов, лабораторий, мастерских и др. объектов для проведения практических и лабораторных занятий	Перечень основного оборудования	Фактический адрес учебных кабинетов, лабораторий, мастерских и др.	Площадь, м <sup>2</sup>	Количество посадочных мест
1	УЛК-301 Аудитория вебконференций. Учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа. Учебная аудитория для проведения занятий семинарского типа. Учебная аудитория для курсового проектирования (выполнения курсовых работ). Учебная аудитория для проведения групповых и индивидуальных консультаций Учебная аудитория для проведения занятий текущего контроля и промежуточной аттестации.	Стол ученический, стол преподавательский, стул, доска (маркерная), кафедра напольная, компьютер, телевизор	445020, Самарская обл., г. Тольятти, ул. Белорусская, 16 В, позиция по ТП №62, 3 этаж (УЛК-301)	30,5	1
2	Г-401 Компьютерный класс. Помещение для самостоятельной работы. Учебная аудитория для проведения занятий семинарского типа. Учебная аудитория для курсового	Стол ученический, стул, ПК с выходом в сеть интернет	445020, Самарская область, г. Тольятти, ул. Белорусская, 14, позиция по ТП № 48, 4 этаж (Г-401)	84,8	16

№ п/п	Наименование оборудованных учебных кабинетов, лабораторий, мастерских и др. объектов для проведения практических и лабораторных занятий	Перечень основного оборудования	Фактический адрес учебных кабинетов, лабораторий, мастерских и др.	Площадь, м²	посадочных мест Количество
	проектирования (выполнения курсовых работ). Учебная аудитория для проведения групповых и индивидуальных консультаций. Учебная аудитория для проведения занятий текущего контроля и промежуточной аттестации.				