

МІНІСТЕРСТВО ОСВІТИ І НАУКИ УКРАЇНИ
ХАРКІВСЬКИЙ НАЦІОНАЛЬНИЙ АВТОМОБІЛЬНО-ДОРОЖНІЙ
УНІВЕРСИТЕТ

ЗАТВЕРДЖУЮ

Заступник ректора ХНАДУ

проф. _____ І.П. Гладкий

«_____» _____ 2011 р.

ПАКЕТ
ЗАСОБІВ ДІАГНОСТУВАННЯ
РІВНЯ ПІДГОТОВКИ ФАХІВЦІВ
з дисципліни «Валютні операції»
(за вимогами кредитно-модульної системи навчання)

Галузь знань – 0305 «Економіка та підприємництво»

Спеціальність – 7.03050301 «Міжнародна економіка»

Харків 2011

Пакет засобів діагностування складений к.в.н., доцентом кафедри міжнародної економіки Бабичем Анатолієм Петровичем.

Рецензент

Зав. кафедри міжнародної економіки
доктор економічних наук, професор

Д.В. Бабич

Пакет засобів діагностування розглянутий та ухвалений на засіданні кафедри міжнародної економіки
(протокол № _____ від « ____ » _____ 201__ р.)

Завідувач кафедри
доктор економічних наук, професор

Д.В. Бабич

Схвалено Радою (методичною комісією) факультету управління та бізнесу
(протокол № _____ від « ____ » _____ 201__ р.)

Голова Ради (методичної комісії)
факультету Управління та бізнесу
доктор економічних наук, професор

І.А. Дмитрієв

СТРУКТУРА НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ (СИСТЕМНИЙ ЗМІСТОВИЙ МОДУЛЬ)

1. Опис навчальної дисципліни

« Валютні операції »

Характеристика обсягів підготовки	Характеристика лекційного поточку	Характеристика навчального процесу
<p>Загальний обсяг – 3 кредити Усього годин – 108 год. Усього змістових модулів – 15. Усього блоків змістових модулів – 3. Усього залікових модулів – 3. Один змістовий модуль – 2-14 год. Один заліковий модуль – 36 год. Усього аудиторних годин на тиждень – 2 (лекцій – 1 год., практичних занять – 1 год.).</p>	<p>Галузь знань 0305 «Економіка та підприємництво». Спеціальність 7.03050301 «Міжнародна економіка» Освітньо-кваліфікаційний рівень – спеціаліст. Кількість навчальних груп у потоці – 1. Лектор, відповідальний за курс – доцент Бабич Анатолій Петрович</p>	<p>Навчальна дисципліна – обов’язкова. Рік підготовки – 5. Семестр навчання – 9. Кількість годин: лекцій – 24, практичних занять – 24, самостійних робіт студентів (СРС) – 60, Модульний контроль (види контролю: усне опитування, письмова контрольна робота, тестові завдання). Підсумковий контроль: інтегрований іспит.</p>

2 Основні терміни, поняття та їх визначення

У збірці використано терміни, подані у Законах України «Про вищу освіту» від 17.01.02р. № 2984-111 та «Про інноваційну діяльність» від 04.07.02 р. № 40-У, Державному класифікаторі професій ДК 003-95, Комплексі нормативних документів для розробки складових системи стандартів вищої освіти (додаток № 1 до наказу МОН України від 31.07.98 р. № 285 зі змінами та доповненнями, що введені розпорядженням МОН України від 05.03.01 р. № 28-р):

– *кредитно-модульна система організації навчального процесу* – це модель організації навчального процесу, яка ґрунтується на поєднанні модульних технологій навчання та залікових освітніх одиниць (залікових кредитів);

– *заліковий кредит* – це одиниця виміру навчального навантаження, необхідного для засвоєння змістових модулів або блоку змістових модулів;

– *модуль* – це задокументована завершена частина освітньо-професійної програми (навчальної дисципліни, практики, державної атестації), що реалізується відповідними формами навчального процесу;

– *змістовий модуль* – це система навчальних елементів, що поєднана за ознакою відповідності певному навчальному об'єкту;

– *заліковий модуль (блок змістових модулів)* – це задокументована завершена система змістових модулів освітньо-професійної програми (навчальної дисципліни, практики, державної атестації), що реалізується відповідними формами навчального процесу;

– *обсяг модуля* – це навчальне навантаження студента з даного модуля в кредитах, що включають аудиторну і самостійну роботу.

3 Загальні положення

Навчальна дисципліна розбивається на змістові модулі. У кожному модулі визначається тематика й обсяг лекцій, семінарських і практичних занять і самостійної роботи студентів, види контролю. За заліковими

модулями розробляються пакети контрольних завдань, що містять перелік теоретичних питань і практичні завдання.

4 Модульний контроль

Система оцінки знань студентів за окремих заліковий модуль складається у балах рейтингу згідно таблиці 1.

Таблиця 1

Система оцінки знань студентів і шкала оцінки
(за кожний заліковий модуль)

За шкалою ECTS	За національною шкалою	За шкалою навчального закладу
A	Відмінно	90 – 100
B	Добре	80 – 89
C	Добре	75 – 79
D	Задовільно	67 – 74
E	Задовільно	60 – 66
FX	Незадовільно з можливістю повторного складання	35 – 59
F	Незадовільно з обов'язковим повторним вивченням дисципліни	1 – 34

5 Підсумковий контроль

Згідно наказу Міністерства освіти і науки України від 30.12.05 р. № 774, підсумкова оцінка Q знань з навчальної дисципліни визначається як середньозважена результатів засвоєння окремих залікових модулів, тобто

$$Q = a_1B_1 + a_2B_2 + \dots + a_nB_n - \text{середньозважена оцінка знань};$$

де a_1, a_2, \dots, a_n – коефіцієнти вагомості відповідних залікових модулів;

$$a_n = \frac{T_{3Mn}}{T_D};$$

T_{3Mn} – обсяг відповідних залікових модулів, у годинах;

T_D – обсяг навчальної дисципліни, у годинах;

n – кількість залікових модулів;

$$a_1 + a_2 + \dots + a_n = 1.$$

6 Приклад оформлення результатів тестування

Результати тестування студент, не переписуючи самих тестових завдань, оформляє на окремому аркуші за такою формою:

Міністерство освіти і науки, молоді та спорту України
Харківський національний автомобільно-дорожній університет
Факультет управління та бізнесу
Кафедра міжнародної економіки
Навчальна дисципліна: «Міжнародний маркетинг»
Проміжний тестовий контроль № 1 (максимальна оцінка – 100 балів)
Дата проведення контролю _____
ПІБ студента _____
Група _____

Завдання частини 1 до залікового модуля 1

1. Міжнародне маркетингове середовище це _____

Завдання частини 2 до залікового модуля 1

1. Економічні фактори зовнішнього середовища міжнародного маркетингу діляться на _____ (число) групи, а саме _____

Завдання частини 3 до залікового модуля 1

1. так
2. ні

Завдання частини 4 до залікового модуля 1

- А. 1, 5, 8
- Б. 3, 7

Завдання частини 5 до залікового модуля 1

1. В
2. А

7 Завдання до залікових модулів

Заліковий модуль 1 (за змістовими модулями 1,2,3,4)

Змістовий модуль (тема) 1. Валютний ринок і його структура

Змістовий модуль (тема) 2. Валютні операції та їх класифікація

Змістовий модуль (тема) 3. Міжнародні валютні розрахунки

Частина 1 (20 балів, кожна вірна відповідь оцінюється у 5 балів)

Умови виконання завдання: дати визначення понять чи короткі відповіді на запитання

1. Валютний ринок – це ...
2. Валютні цінності – це ...
3. Валютний курс – це ...
4. Валютний режим – це ...
5. Крос - курс – це ...
6. Конвертованість валюти – це ...
7. Валютні операції – це ...
8. Валютна позиція – це ...
9. Неторгові валютні операції – це ...
10. Акредитив – це ...
11. Банківський переказ – це ...
12. Ікасо – це ...

Частина 2 (25 балів, кожна вірна відповідь оцінюється у 5 балів)

Умови виконання завдання: вставити пропущені слова, вирази, числа

1. Існує _____ (число) форм міжнародних валютних розрахунків, а саме _____
2. До _____ основних принципів видів валютних операцій відносяться: _____
3. Існує _____ (число) видів валютних курсів, а саме _____
4. Існує _____ (число) чинників формування валютних курсів, а саме _____
5. Існує _____ (число) елементів оцінювання валютних ризиків, а саме _____
6. Визначають _____ (число) типів валютних позицій, а саме _____
7. Визначають _____ (число) учасників валютних ринків, а саме _____
8. Визначають _____ (число) видів конверсійних валютних операцій, а саме _____
9. Існує _____ (число) типи валютних ризиків, а саме _____
10. Розрізняють _____ (число) типів валютних опціонів, а саме _____

Частина 3 (20 балів, кожна вірна відповідь оцінюється у 4 бали)

Умови виконання завдання: Чи згодні Ви з таким твердженням? (ТАК, НІ)

1. У зв'язку з розширенням міжнародної торгівлі та міжнародних економічних зв'язків обсяги торгівлі валютою постійно зменшуються.
2. Діяльність з видобутку та реалізації дорогоцінного каміння регулюється валютним правом України.
3. Звичайно угоди на валютному ринку укладаються за усною домовленістю.
4. Враховуючи те що валютні операції (у більшості випадків) - це операції, які здійснюють банківські установи, їх можна поділити на пасивні валютні операції і активні валютні операції
5. До конверсійних валютних операцій належать ф'ючерсні, опціонні, та форвардні валютні операції.
6. Валютними цінностями є ювелірні, промислові і побутові вироби із золота і метали іридієво-платинової групи.
7. Валюта, стійка щодо власного номіналу, а також курсів інших валют, класифікується як резервна.
8. Кількість одиниць кожної валюти у наборі валют, що формують валютний кошик, - це валютний компонент
9. Якщо при котируванні курс одиниці національної валюти виражається в іноземній валюті, то це пряме котирування
10. У разі рівності вимог і зобов'язань банку чи підприємства в іноземній валюті валютна позиція вважається відкритою

Частина 4 (15 балів, по 5 балів за кожну правильну відповідь)

Умови виконання завдання: Визначити, які показники групи II відповідають показнику групи I?

Група I

А. Особливостями валютного ринку є:

Б. Головними функціями валютного ринку є

Група II

1 нематеріальний

2 визначення і формування попиту та пропозиції на іноземні валюти
3. існує цілковита свобода моментального відкриття чи закриття будь-якої позиції, можливість торгувати 24 години на добу в режимі on line

4 реалізація валютної політики держави, спрямованої на забезпечення

регулювання національної економіки та розширення зовнішньоекономічних зв'язків;

- 5 одержання прибутку від операцій з валютою та валютними цінностями тощо
- 6 не має конкретного місцезнаходження, єдиного центру

Частина 5 (20 балів, по 2 бали за кожну правильну відповідь)

Умови виконання завдання: *Оберіть правильну відповідь*

1. Фінансова операція «арбітраж» належить до:
 - a) інвестиційних операцій;
 - b) операцій з капіталом.
 - c) операцій з переказу грошей;
 - d) спекулятивних операцій;
2. Перетворюючись у валюту, гроші беруть на себе додаткову функцію:
 - a) загальний еквівалент в процесі обміну товарів.
 - b) засіб платежу;
 - c) міра вартості;
 - d) стають товаром, продаються і купуються, мають ціну в грошових одиницях іншої країни;
3. Залежно від приналежності (статусу) валюта поділяється на:
 - a) сильну (тверду) та слабку (м'яку) валюту.
 - b) національну, іноземну, міжнародну (регіональну);
 - c) іноземну, міжнародну (регіональну);
 - d) вільно конвертовану, частково конвертовану та неконвертовану валюту;
4. Валюта, стійка щодо власного номіналу, а також курсів інших валют, класифікується як:
 - a) тверда;
 - b) резервна;
 - c) міжнародна.
 - d) м'яка;
5. Зниження курсу національної чи міжнародної (регіональної) валютно-грошової одиниці щодо валют інших країн та міжнародних валютно-грошових одиниць – це:
 - a) девальвація;
 - b) ревальвація;
 - c) валютна інтервенція;
 - d) валютний паритет.

6. Збільшення золотого вмісту або підвищення курсу національної чи міжнародної регіональної валютно-грошової одиниці щодо валют інших країн, міжнародних валютно-грошових одиниць:
- a) валютна інтервенція;
 - b) валютний курс.
 - c) девальвація;
 - d) ревальвація;
7. З метою підвищення курсу власної грошової одиниці центральний банк:
- a) продає іноземну валюту;
 - b) скуповує тверду валюту в обмін на національну;
 - c) скуповує резервну валюту в обмін на національну;
 - d) продає національну валюту.
8. Форма впливу центрального банку на формування курсу національної валюти, коли центральний банк продає або купує великі партії твердих валют за національну валюту, має назву:
- a) ревальвація;
 - b) девальвація.
 - c) валютна конвертація;
 - d) валютна інтервенція;
9. Можливість покривати дефіцит платіжного балансу національною валютою мають країни-емітенти:
- a) резервних валют;
 - b) твердих валют;
 - c) неконвертованих валют;
 - d) не має правильної відповіді.
10. Історично спочатку виникли:
- a) національні валютні системи;
 - b) регіональні валютні системи;
 - c) міжнародні валютні системи;
 - d) світові валютні системи.

Заліковий модуль 2
(за змістовими модулями 5,6,7,8,9,10)

Змістовий модуль (тема) 5. Валютні операції з негайною поставкою

Змістовий модуль (тема) 6. Термінові валютні операції

Змістовий модуль (тема) 7. Валютні операції СВОП

Змістовий модуль (тема) 8. Валютний арбітраж

Змістовий модуль (тема)9. Форфейтингові, лізингові та факторингові операції

Змістовий модуль (тема). 10 Неторгові валютні операції

Частина 1 (20 балів, кожна вірна відповідь оцінюється у 5 балів)

Умови виконання завдання: дати визначення понять чи короткі відповіді на запитання.

1. Процентні свопи – це...
2. Розрахункова ціна позиції – це...
3. Плаваюча процентна ставка – це...
4. Валютний ф'ючерс – це...
5. Ринок депозитних операцій в іноземній валюті – це...
6. Опціонні угоди – це...
7. Валютний своп – це...
8. Біржові опціони – це...
9. Експортний лізинг – це...
10. Валютний дилер – це...
11. Маркет-юзер – це...
12. Трейдер – це...
13. Фіксована валютна угода «аутрайт» – це...
14. Форфейтингова операція – це...
15. Факторингова операція – це...

Частина 2 (25 балів, кожна вірна відповідь оцінюється у 5 балів)

Умови виконання завдання: вставити пропущені слова, вирази, числа

1. Курси валют на спот ринку є базовими для розрахунку курсу всіх термінових угод, а саме _____
2. Існує _____ (число) видів термінових валютних операцій, а саме _____
3. Міжнародні платежі включають _____ (число) необхідних умов, а саме _____
4. Відкрита валютна позиція буває _____ (число) видів, а саме _____
5. На міжбанківському валютному ринку проводяться _____ (число) видів валютних операцій, а саме _____
6. Валютні обмеження встановлені відповідно до чинного _____ і проявляються у встановленні _____
7. До валютних цінностей відносяться _____
8. Плаваючий (вільний) курс – це курс у таких формах: _____ (число), а саме _____
9. Лізинг непрямий, коли співвласником є фірми-лізингодавця чи лізингоодержувача є _____
10. Офіційне зниження і підвищення фіксованого курсу національної валюти це, відповідно, _____ і _____.

Частина 3 (20 балів, кожна вірна відповідь оцінюється у 4 бали)

Умови виконання завдання: Чи згодні Ви з таким твердженням? (ТАК, НІ)

1. На біржовий ринок припадає близько 90% обороту іноземної валюти
2. Для здійснення валютних операцій у комерційних банках створюються підрозділи — дилінгові центри
3. Небанківські установи мають право здійснювати валютні операції тільки на підставі агентських угод, що укладаються між уповноваженими банками та іншими суб'єктами, які бажають здійснювати валютні операції.
4. На багатoproфільних або на спеціальних біржах створюються спеціальні підрозділи, які займаються валютними операціями
5. Угода tomorrow - це комбінація двох протилежних конверсійних операцій з різними датами валютування
6. Угода аутрайт - це комбінація двох протилежних конверсійних операцій з різними датами валютування
7. Міжнародний валютний кліринг - це заліки взаємних вимог і зобов'язань сторін по їх взаємній згоді
8. Реальний курс - це курс, який визначається на основі ринкової вартості товарів
9. Курс-спот - це курс, по якому обмінюються валюти тільки упродовж двох днів після домовленості по курсу
10. Угода своп - це комбінація двох протилежних конверсійних операцій з різними датами валютування

Частина 4 (15 балів, по 5 балів за кожен правильну відповідь)

Умови виконання завдання: *Визначити, які показники групи II відповідають показнику групи I?*

Група I

- А. До основних умов міжнародних розрахунків у формі акредитиву відносяться.
- Б. До основних умов міжнародних розрахунків у формі інкасо відносяться
- В. До основних умов валютного контракту типу спот відносятьс

Група II

5. Можливість проведення угод типу "Today"
1. Курс постачання на момент укладення угоди
6. Доручення експортера своєму банку отримати від імпортера певну суму
7. Регулюється міжнародними правилами Міжнародної торгової палати № 522 від 01.01.1995 року
2. Платіж робиться банком одержувача товару
3. Зняття грошей з рахунку плетельщика робиться після відправки товару
8. Можливість проведення угод типу "Tomorrow"
9. Учасником операції є банк - ремітент
4. Банк емітент діє за дорученням платника

Частина 5 (20 балів, по 2 бали за кожну правильну відповідь)**Умови виконання завдання:** *Оберіть правильну відповідь*

1. Близько 90% обороту іноземної валюти припадає на:
 - a) позабіржовий ринок;
 - b) біржовий ринок;
 - c) ринок капіталів;
 - d) грошовий ринок.
2. Найбільшу частку обороту валюти має:
 - a) форвардний ринок;
 - b) спот-ринок;
 - c) своп-ринок;
 - d) ринок деривативів.
3. За спеціалізацією валютні ринки поділяються на:
 - a) ринки окремих розрахункових одиниць, ринки процентних ставок на іноземні валюти та ринки конверсійних операцій;
 - b) форексний ринок та готівковий (банкнотний) ринок;
 - c) вільні та невольні (обмежені);
 - d) форвардний ринок, своп-ринок та ринок деривативів.
4. До валютних операцій не належать:
 - a) отримання і надання кредитів в національній валюті;
 - b) використання валютних цінностей як засобу платежу;
 - c) вивезення та ввезення валютних цінностей;
 - d) пересилання та переказування валютних цінностей;
5. Купівля-продаж валют на умовах «спот» означає, що:
 - a) обмін валют здійснюється за раніше узгодженим курсом, угоди укладаються сьогодні, проте дата валютування (дата виконання контракту) відкладена на визначений термін у майбутньому;
 - b) курс валют фіксується на день купівлі-продажу, її поставка здійснюється у той же робочий (банківський) день;
 - c) курс валют фіксується на день купівлі-продажу, а її поставка здійснюється на другий робочий (банківський) день (без урахування дня продажу);
 - d) валюта купується або продається на умовах «своп» із одночасним продажем (або купівлею) тієї самої валюти на певний термін на умовах «форвард»;
6. Розрізняють такі поточні валютні операції:
 - a) спот, тод, том;
 - b) своп, тод, том;
 - c) своп, ф'ючерс, форвард;
 - d) спот, ф'ючерс, форвард.
7. До поточних валютних операцій відносяться операції:

- a) з короткими термінами валютування – в межах трьох робочих днів;
 - b) з короткими термінами валютування – в межах тижня;
 - c) з довгими термінами валютування – в межах трьох років;
 - d) з довгими термінами валютування – в межах місяця;
8. Термін поставки валюти називають:
- a) датою валютування;
 - b) датою здійснення угоди;
 - c) валютною позицією;
 - d) валютним паритетом.
9. Стандартними умовами виконання валютної операції Tom / next є:
- a) дата укладання угод – сьогодні; дата валютування – сьогодні; період - 1 день; дата завершення – післязавтра;
 - b) дата укладання угод – сьогодні; дата валютування – завтра; період - 2 дні; дата завершення – післязавтра;
 - c) дата укладання угод – сьогодні; дата валютування – завтра; період - 2 дні; дата завершення – завтра+7 днів;
 - d) дата укладання угод – сьогодні; дата валютування – завтра; період - 1 день; дата завершення – завтра;
10. Стандартними умовами виконання валютної операції Spot / next є:
- a) дата укладання угод – сьогодні; дата валютування – сьогодні; період - 1 день; дата завершення – післязавтра;
 - b) дата укладання угод – сьогодні; дата валютування – завтра; період - 1 день; дата завершення – завтра;
 - c) дата укладання угод – сьогодні; дата валютування – другий робочий день; період - 1 день; дата завершення – третій робочий день;
 - d) дата укладання угод – сьогодні; дата валютування – другий робочий день; період - 2 дні; дата завершення – завтра;

Заліковий модуль 3

(за змістовими модулями 12,13,14)

Змістовий модуль (тема) 12. Відкриття і ведення валютних рахунків

Змістовий модуль (тема) 13. Кореспондентські відносини з іноземними банками

Змістовий модуль (тема) 14. Контроль та регулювання валютних операцій

Частина 1 (20 балів, кожна вірна відповідь оцінюється у 5 балів)

Умови виконання завдання: дати визначення понять чи короткі відповіді на запитання.

1. Ліцензування банківських операцій – це...
2. Дилінговий центр – це...

3. Документарне інкасо – це...
4. Документарний акредитив – це...
5. Валютна інтервенція – це...
6. Резервна валюта – це...
7. Неторговельні валютні операції – це...
8. Торговельні валютні операції – це...
9. Вексель – це...
10. Чек – це...
11. Кореспондентський рахунок – це...
12. Ощадний (депозитний) сертифікат – це...
13. Депозити на визначений строк – це...
14. Міжбанківські кореспондентські відносини – це...
15. Поточний рахунок з овердрафтом – це...
16. Валютна позиція банку – це...
17. Дисконтна політика – це...
18. Плаваюча процентна ставка – це...
19. Вкладний (депозитний) рахунок – це...
20. Об'єктом валютного регулювання є...

Частина 2 (25 балів, кожна вірна відповідь оцінюється у 5 балів)

Умови виконання завдання: вставити пропущені слова, вирази, числа

1. . Банківська ліцензія, письмовий дозвіл та ліцензії на виконання окремих операцій оформляються _____, підписуються _____, і засвідчується відбитком гербової печатки
2. Проведення операцій з негайною поставкою тісно пов'язане з необхідністю контролювати надходження у валюті та валютних цінностях на рахунки та їх залишки, тобто з контролем _____
3. Біржові торги проводяться на підставі та відповідно зі _____ і законодавством України, що регулює проведення валютних операцій
4. Факторингова операція передбачає _____ (число) послідовних етапів, а саме _____
5. При укладенні _____ угод особлива увага зосереджується на даті валютування, тобто на узгодженні сторонами дати поставки коштів на рахунок банку-контрагента
6. Класифікувати конверсійні валютні операції можна залежно від _____ угоди і дати _____
7. Неторговельні валютні операції можуть об'єднувати валютні операції, які стосуються обслуговування _____, що не займаються підприємницькою діяльністю, а також послуги, які

- надаються _____ і не стосуються
безпосередньо їх комерційної діяльності
8. Валютні обмеження встановлені відповідно до чинного
_____ і проявляються у встановленні

9. Рішення про видачу банківської ліцензії, письмового дозволу та
ліцензій на виконання окремих операцій чи про відмову в їх наданні
приймає Комісія _____ протягом
_____ з дня отримання повного пакета документів
- 10.. Залежно від території проведення валютних операцій виділяють
валютні операції, пов'язані з міжнародними розрахунками.
Інструменти, які можуть застосовуватись при проведенні даних
операцій: _____;
_____;

Частина 3 (20 балів, кожна вірна відповідь оцінюється у 4 бали)

Умови виконання завдання: Чи згодні Ви з таким твердженням? (ТАК, НІ)

1. Основним товаром валютного ринку є іноземна валюта в різних формах: валютні депозити, будь-які фінансові вимоги, позначені в іноземній валюті
2. Банк має право здійснювати валютні операції тільки після отримання банківської ліцензії
3. При форфейтингових операціях банк бере на себе усі ризики по отриманню боргу від покупця
4. Міжнародний валютний кліринг - це заліки взаємних вимог і зобов'язань сторін по їх взаємній згоді
5. Враховуючи те що валютні операції (у більшості випадків) - це операції, які здійснюють банківські установи, їх можна поділити на пасивні валютні операції і активні валютні операції
6. Основний обсяг валютних операцій припадає на небанківські установи, які формують міжбанківський валютний ринок через здійснення всього спектра операцій з іноземною валютою
7. Діяльність з видобутку та реалізації дорогоцінного каміння регулюється валютним правом України.
8. За обсягом біржовий ринок невеликий, оскільки функціонує в основному як національний валютний ринок
9. Проведення операцій з валютою та валютними цінностями потребує наявності банківської ліцензії та отримання письмового дозволу Національного банку України
10. Укладення і підтвердження угод з купівлі-продажу іноземних валют І групи Класифікатора за гривні між уповноваженими банками (уповноваженими фінансовими установами) проводиться у будь-який час.

Частина 4 (15 балів, по 5 балів за кожен правильну відповідь)

Умови виконання завдання: Визначити, які показники групи II відповідають показнику групи I?

Група I	Група II
А. До конверсійних валютних операцій відносяться	1. Документарні акредитиви
Б. До неторгових валютних операцій відносяться	2. Факторингові операції
В. До операцій по розміщенню валюти відносяться	3. Обмін валюти в обмінних пунктах
Г. До розрахункових валютних операцій відносяться	4. Валютний арбітраж
	5. Документарний інкасо
	6. Валютні депозити
	7. Обслуговування пластикових карт
	8. Термінові валютні операції
	9. Банківський переказ
	10. Валютні кредити
	11. Обслуговування дорожніх чеків
	12. Опціони..

А		В	
Б		Г	

Частина 5 (20 балів, по 2 бали за кожну правильну відповідь)

Умови виконання завдання: Оберіть правильну відповідь

1. Спред розраховується за формулою:

a)
$$\frac{\text{Ціна}_{\text{продавця}} - \text{Ціна}_{\text{покупця}}}{\text{Ціна}_{\text{продавця}}} = \text{Спред};$$

b)
$$\frac{\text{Ціна}_{\text{покупця}} - \text{Ціна}_{\text{продавця}}}{\text{Ціна}_{\text{продавця}}} = \text{Спред};$$

c)
$$\frac{\text{Ціна}_{\text{продавця}} - \text{Ціна}_{\text{покупця}}}{\text{Ціна}_{\text{покупця}}} = \text{Спред};$$

d)
$$\frac{\text{Ціна}_{\text{покупця}} - \text{Ціна}_{\text{продавця}}}{\text{Ціна}_{\text{покупця}}} = \text{Спред};$$

2. Розмір спреду, як правило, більший при:

- швидкій зміні валютного курсу;
- при угодах на великі суми;
- для разових клієнтів банку;
- не має правильної відповіді.

3. У разі рівності вимог і зобов'язань банку чи підприємства в іноземній валюті валютна позиція вважається:
- закритою;
 - відкритою;
 - довгою закритою;
 - короткою відкритою.
4. Форвардний валютний курс розраховується:
- на момент укладання угоди;
 - на момент виконання угоди;
 - на дату виконання операції «спот».
 - на дату валютування;
5. Специфікою форвардних операцій є те, що форвардний валютний курс:
- фіксується;
 - фіксується на момент виконання угоди;
 - розраховується;
 - не має правильної відповіді.
6. Якщо форвардний курс валюти вищий від поточного, для його визначення до спот-курсу додається:
- форвардний дисконт;
 - форвардна премія;
 - спред;
 - курс «аутрайт»;
7. Якщо форвардний курс нижчий від поточного, він визначається відніманням від значення спот-курсу:
- форвардної премії;
 - форвардної знижки (дисконту);
 - курсу «спот».
 - курсу «аутрайт»;
8. Чим триваліший форвардний період, тим вищим буде:
- спот-курс продажу валюти;
 - спот-курс купівлі валюти;
 - рівень валютного ризику;
 - курс «аутрайт».
9. Для визначення курсу «аутрайт» на купівлю валюти форвардна премія (П) чи дисконт (Д) розраховуються за формулою:
- $$П(Д)_{куп} = \frac{Кс.куп(Сд.в - Скр.б)T}{360 + C_{кр.б} \cdot T};$$
 - $$П(Д)_{куп} = \frac{Кс.куп(Сд.в - Скр.б)T}{360 \cdot 100 + C_{д.в} \cdot T};$$
 - $$П(Д)_{куп} = \frac{Кс.куп(Скр.б - Сд.в)T}{360 \cdot 100 + C_{д.в} \cdot T};$$
 - $$П(Д)_{куп} = \frac{Кс.куп(Сд.в - Скр.б)T}{360 \cdot 100 + C_{кр.б} \cdot T}$$

де $P(D)_{куп}$ - премія (або дисконт) для форвардного курсу купівлі певної валюти; $K_{с.куп}$ – спот-курс купівлі певної валюти; $C_{д.в}$ – відсоткова ставка за міжбанківськими депозитами для валюти котирування; $C_{кр.б}$ – відсоткова ставка за міжбанківськими кредитами для базової валюти (база котирування); T – термін у днях, на який розраховується форвардний курс.

10. Класичні «свопи» залежно від послідовності виконаних операцій «спот» і «форвард» поділяються на:

- a) репорт і дефолт;
- b) репорт і депорт;
- c) репо і дефолт;
- d) репо і депорт;

8 Методичне забезпечення

Навчально-методичні матеріали (навчальна програма дисципліни, завдання до практичних заняття, списки рекомендованої літератури, матеріали для самостійної роботи студентів), що представлені на кафедрі.

Навчально-методичні матеріали (навчальні посібники, навчальна програма дисципліни, плани семінарських занять, методичні вказівки до практичних занять та самостійної роботи студентів, списки рекомендованої літератури), що представлені на кафедрі.

Матеріали кафедри міжнародної економіки з дисципліни на освітньому порталі ХНАДУ (<http://portal.khadi.kharkov.ua>) та сайті дистанційного навчання ХНАДУ (<http://dl.khadi.kharkov.ua>).

9 Література, що рекомендована для самостійної роботи студентів (залікові модулі 1-15)

1. Коринець С.Я. Міжнародні фінанси: Підручник. – К.: Знання, 2006. – 494 с.
2. Валютні операції: порядок здійснення та облік. – Х.: Фактор, 2008. – 256 с.
3. Внешнеэкономическая деятельность / Б.М. Смитиенко, В.К. Поспелов, С.В. Карпова и др. / Под ред. Б.М. Смитиенко, В.К. Поспелова. – М.: Мастерство, 2002. – 304с.
4. Загородній А.Г., Сліпушко О.М., Вознюк Г.Л., Смовженко Т.С. Словник банківських термінів. Банківська справа: термінологічний словник – К.: Вид-во «АКОНІТ», 2000. – 605 с.
5. Козак Ю.Г., Логвинова Н.С., Ковалевський В.В. Міжнародні фінанси: Навч. посібник. – К.: Центр учбової літератури, 2007. – 640 с.

6. Міжнародні фінанси: Підручник / О.І. Рогач, А.С. Філіпенко, Т.С. Шемет та ін. – К.: Либідь, 2003. – 784 с.
7. Опарін В.М. Фінанси (Загальна теорія): Навч. посібник. – К.: КНЕУ, 2002. – 240 с.
8. Рязанова Н.С. Міжнародні фінанси: Навч.-метод. посібник для самост. вивч. дисц. – К.: КНЕУ, 2001. – 119 с.
9. Софіщенко І.Я. Міжнародні фінанси: Навч. посіб. – К.: МАУП, 2005. – 200 с.
10. Фінанси: Навч.-метод. посібник для самост. вивч. дисц. / О.Р. Романенко, С.Я. Огородник, М.С. Зязюн, А.А. Славкова. – К.: КНЕУ, 2003. – 387 с.
11. Ющенко В.А., Міщенко В.І. Валютне регулювання: Навч. посіб. – К.: Т-во «Знання», КОО, 1999. – 359 с.
12. Ющенко В.А., Міщенко В.І. Управління валютними ризиками: Навч. посіб. – К.: Т-во «Знання», КОО, 1998. – 444 с.

Укладач:
доцент кафедри
міжнародної економіки

А.П.Бабич