

ФЕДЕРАЛЬНОЕ АГЕНТСТВО ЖЕЛЕЗНОДОРОЖНОГО ТРАНСПОРТА

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение  
высшего образования  
«Иркутский государственный университет путей сообщения»  
(ФГБОУ ВО ИРГУПС)

УТВЕРЖДЕНА  
приказом ректора  
от «31» мая 2024 г. № 425-1

**Б1.В.ДВ.13.02 Финансовый и валютный дилинг**

**рабочая программа дисциплины**

Специальность/направление подготовки – 38.03.01 Экономика

Специализация/профиль – Финансы и кредит

Квалификация выпускника – Бакалавр

Форма и срок обучения – очная форма 4 года

Кафедра-разработчик программы – Финансовый и стратегический менеджмент

Общая трудоемкость в з.е. – 3

Часов по учебному плану (УП) – 108

В том числе в форме практической подготовки (ПП) –

4

(очная)

Формы промежуточной аттестации

очная форма обучения:

зачет 8 семестр

Очная форма обучения		Распределение часов дисциплины по семестрам	
Семестр	8	Итого	
Вид занятий	Часов по УП	Часов по УП	
<b>Аудиторная контактная работа по видам учебных занятий/ в т.ч. в форме ПП*</b>	36/4	<b>36/4</b>	
– лекции	12	<b>12</b>	
– практические (семинарские)	24/4	<b>24/4</b>	
– лабораторные			
<b>Самостоятельная работа</b>	72	<b>72</b>	
<b>Итого</b>	108/4	<b>108/4</b>	

\* В форме ПП – в форме практической подготовки.

ИРКУТСК

Электронный документ выгружен из ЕИС ФГБОУ ВО ИРГУПС и соответствует оригиналу

Подписант ФГБОУ ВО ИРГУПС Трофимов Ю.А.

00920FD815CE68F8C4CA795540563D259C с 07.02.2024 05:46 по 02.05.2025 05:46 GMT+03:00

Подпись соответствует файлу документа



Рабочая программа дисциплины разработана в соответствии с федеральным государственным образовательным стандартом высшего образования – бакалавриат по направлению подготовки 38.03.01 Экономика, утвержденным Приказом Министерства науки и высшего образования Российской Федерации от 12.08.2020 № 954.

Программу составил(и):

д.э.н., профессор, профессор, И.Ю. Сольская

Рабочая программа рассмотрена и одобрена для использования в учебном процессе на заседании кафедры «Финансовый и стратегический менеджмент», протокол от «21» мая 2024 г. № 8

Зав. кафедрой, к. э. н., доцент

С.А. Халетская

<b>1 ЦЕЛЬ И ЗАДАЧИ ДИСЦИПЛИНЫ</b>	
<b>1.1 Цель дисциплины</b>	
1	освоение основных понятий финансового и валютного дилинга для принятия инвестиционных решений, решений по финансированию, формированию дивидендной политики и структуры капитала, в том числе, при принятии решений, связанных с операциями на мировых рынках в условиях глобализации
<b>1.2 Задачи дисциплины</b>	
1	сформировать у обучающихся понимание принципов и особенностей финансового и валютного дилинга
2	уточнить представления обучающихся об особенностях финансовой, предпринимательской среды предприятия и сопряженных с ней рисках дилинговых операций
3	сформировать навыки основных операций, проводимых финансовым менеджером на финансовом и валютном рынке в условиях риска
<b>1.3 Цель воспитания и задачи воспитательной работы в рамках дисциплины</b>	
Научно-образовательное воспитание обучающихся	
Цель научно-образовательного воспитания – создание условий для реализации научно-образовательного потенциала обучающихся в форме наставничества, тьюторства, научного творчества. Цель достигается по мере решения в единстве следующих задач: – формирование системного и критического мышления, мотивации к обучению, развитие интереса к творческой научной деятельности; – создание в студенческой среде атмосферы взаимной требовательности к овладению знаниями, умениями и навыками; – популяризация научных знаний среди обучающихся; – содействие повышению привлекательности науки, поддержка научно-технического творчества; – создание условий для получения обучающимися достоверной информации о передовых достижениях и открытиях мировой и отечественной науки, повышения заинтересованности в научных познаниях об устройстве мира и общества; – совершенствование организации и планирования самостоятельной работы обучающихся как образовательной технологии формирования будущего специалиста путем индивидуальной познавательной и исследовательской деятельности	
Профессионально-трудовое воспитание обучающихся	
Цель профессионально-трудового воспитания – формирование у обучающихся осознанной профессиональной ориентации, понимания общественного смысла труда и значимости его для себя лично, ответственного, сознательного и творческого отношения к будущей деятельности, профессиональной этики, способности предвидеть изменения, которые могут возникнуть в профессиональной деятельности, и умению работать в изменённых, вновь созданных условиях труда. Цель достигается по мере решения в единстве следующих задач: – формирование сознательного отношения к выбранной профессии; – воспитание чести, гордости, любви к профессии, сознательного отношения к профессиональному долгу, понимаемому как личная ответственность и обязанность; – формирование психологии профессионала; – формирование профессиональной культуры, этики профессионального общения; – формирование социальной компетентности и другие задачи, связанные с имиджем профессии и авторитетом транспортной отрасли	

<b>2 МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОПОП</b>	
Блок/часть ОПОП	Блок 1. Дисциплины / Часть, формируемая участниками образовательных отношений
<b>2.1 Дисциплины и практики, на которых основывается изучение данной дисциплины</b>	
1	Б1.В.ДВ.02.01 Экономический анализ
2	Б1.В.ДВ.03.01 Финансовая экономика: инструментальные методы
3	Б1.В.ДВ.05.01 Финансовый мониторинг
4	Б1.В.ДВ.06.01 Рынок ценных бумаг
5	Б1.В.ДВ.12.01 Долгосрочная финансовая стратегия
6	Б1.В.ДВ.14.01 Валютный рынок
<b>2.2 Дисциплины и практики, для которых изучение данной дисциплины необходимо как предшествующее</b>	
1	Б2.О.04(Пд) Производственная - преддипломная практика
2	Б3.01(Д) Подготовка к процедуре защиты выпускной квалификационной работы
3	Б3.02(Д) Защита выпускной квалификационной работы

**3 ПЛАНИРУЕМЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ,  
СООТНЕСЕННЫЕ С ТРЕБОВАНИЯМИ К РЕЗУЛЬТАТАМ ОСВОЕНИЯ  
ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ**

Код и наименование компетенции	Код и наименование индикатора достижения компетенции	Планируемые результаты обучения
ПК-2.2 Способен организовывать и поддерживать долгосрочные отношения со стратегическими партнерскими организациями (рейтинговыми агентствами, аудиторскими организациями, оценочными фирмами)	ПК-2.2.2 Анализирует состояние и прогнозирует изменения инвестиционного и информационного рынков	Знать: особенности анализа финансового рынка; особенности анализа и оценки рисков операций финансового и валютного дилинга; теоретические и практические аспекты деятельности на инвестиционном и информационном рынках
		Уметь: учитывать принципы построения торговых систем при работе на организованных валютных рынках; осуществлять сбор, анализ и обработку данных, необходимых для проведения операций на организованных валютных рынках; на основе описания экономических процессов и явлений строить стандартные теоретические и эконометрические модели, анализировать и содержательно интерпретировать полученные результаты
		Владеть: навыками оценки основных направлений развития операций на валютном рынке; методами разработки и принятия управленческих решений в области дилинга; приемами принятия управленческих решений в области инвестиционной деятельности
ПК-2.5 Способен давать комплексную консультацию клиентов по основным формам финансовых услуг, включая контроль подготовки и исполнения договоров и контрактов по направлениям деятельности в области финансового консультирования	ПК-2.5.2 Консультирует клиентов по оформлению документов на выдачу кредитов, открытие депозитов физическим лицам, выпуску пластиковых карт, предоставлении услуг на рынке ценных бумаг, по оформлению операций по определению взаимных обязательств (клиринг)	Знать: особенности услуг на финансовом рынке; особенности анализа и оценки рисков дилинговых услуг; теоретические и практические аспекты дилинговой деятельности
		Уметь: анализировать и интерпретировать финансовую, бухгалтерскую и иную информацию о состоянии финансового рынков; разрабатывать стратегию деятельности потребителей дилинговых услуг; оценить ситуацию на рынке дилинговых услуг
		Владеть: навыками оценки основных направлений дилинговых операций; методами разработки и принятия управленческих решений в области дилинга; приемами принятия управленческих решений в области дилинга

#### 4 СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Код	Наименование разделов, тем и видов работ	Очная форма				*Код индикатора достижения компетенции
		Семестр	Часы			
			Лек	Пр	Лаб	
<b>1.0</b>	<b>Раздел 1. Базовые концепции финансового и валютного дилинга.</b>					
1.1	Тема 1.1. Сущность, предмет и объект финансового дилинга. Генезис науки об управлении финансами. Ключевые концепции финансового и валютного дилинга.	8	1	3		ПК-2.2.2 ПК-2.5.2
1.2	Тема 1.2. Обзор источников информации о финансовом состоянии компании и качестве финансового управления	8	1	3		ПК-2.2.2 ПК-2.5.2
<b>2.0</b>	<b>Раздел 2. Формирование капитальных активов.</b>					
2.1	Тема 2.1. Долевой капитал корпорации. Сущность и способы привлечения. Источники долевого капитала.	8	2	2		ПК-2.2.2 ПК-2.5.2
2.2	Тема 2.2. Долговой капитал корпорации. Сущность и способы привлечения. Источники долгового капитала.	8	2	4/2		ПК-2.2.2 ПК-2.5.2
2.3	Тема 2.3. Модель оценки капитальных активов как основа методики анализа премии за риск.	8	2	4/2		ПК-2.2.2 ПК-2.5.2
<b>3.0</b>	<b>Раздел 3. Операции финансового и валютного дилинга.</b>					

#### 4 СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Код	Наименование разделов, тем и видов работ	Очная форма				*Код индикатора достижения компетенции	
		Семестр	Часы				
			Лек	Пр	Лаб		СР
3.1	Тема 3.1. Операции с валютными вкладами.	8	2	4		9	ПК-2.2.2 ПК-2.5.2
3.2	Тема 3.2 Конверсионные операции. Арбитраж.	8	1	2		9	ПК-2.2.2 ПК-2.5.2
3.3	Тема 3.3. Дилинг на Форекс. Спред. Своп.	8	1	2		9	ПК-2.2.2 ПК-2.5.2
	Форма промежуточной аттестации – зачет	8					ПК-2.2.2 ПК-2.5.2
	Итого часов (без учёта часов на промежуточную аттестацию)		12	24/4		72	

#### 5 ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ УСПЕВАЕМОСТИ И ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

Фонд оценочных средств для проведения текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации по дисциплине оформлен в виде приложения № 1 к рабочей программе дисциплины и размещен в электронной информационно-образовательной среде Университета, доступной обучающемуся через его личный кабинет

#### 6 УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

##### 6.1 Учебная литература

##### 6.1.1 Основная литература

	Библиографическое описание	Кол-во экз. в библиотеке/ онлайн
6.1.1.1	Агибалов, А. В. Международные финансы : учебное пособие / А. В. Агибалов, Е. Е. Бичева, О. М. Алещенко. — Воронеж : ВГАУ, 2015. — 241 с. — URL: <a href="https://e.lanbook.com/book/181764">https://e.lanbook.com/book/181764</a> (дата обращения: 15.04.2024). — Текст : электронный.	Онлайн
6.1.1.2	Алексеева, Д. Г. Современная банковская система Российской Федерации : учебник для вузов / Д. Г. Алексеева [и др.] ; ответственные редакторы Д. Г. Алексеева, С. В. Пыхтин. — Москва : Юрайт, 2024. — 290 с. — URL: <a href="https://urait.ru/bcode/538435">https://urait.ru/bcode/538435</a> (дата обращения: 22.04.2024). — Текст : электронный.	Онлайн
6.1.1.3	Гурнович, Т. Г. Валютные и международные операции банка : учебное пособие для студентов магистратуры (направление подготовки – 080300.62 "финансы и кредит", профиль подготовки: "банковский менеджмент") / Т. Г. Гурнович, Ю. М. Склярова, Л. А. Латышева. — Ставрополь : СтГАУ, 2014. — 248 с. — URL: <a href="http://e.lanbook.com/books/element.php?pl1_id=61105">http://e.lanbook.com/books/element.php?pl1_id=61105</a> (дата обращения: 15.04.2024). — Текст : электронный.	Онлайн

##### 6.1.2 Дополнительная литература

	Библиографическое описание	Кол-во экз. в библиотеке/ онлайн
6.1.2.1	Щеголева, Н. Г. Валютный рынок и валютные операции : учебник для вузов / Н. Г. Щеголева. — Москва : Юрайт, 2024. — 457 с. — URL: <a href="https://urait.ru/bcode/544446">https://urait.ru/bcode/544446</a> (дата обращения: 22.04.2024). — Текст : электронный.	Онлайн
6.1.2.2	Гузнов, А. Г. Регулирование, контроль и надзор на финансовом рынке в Российской Федерации : учебное пособие для вузов / А. Г. Гузнов, Т. Э. Рождественская. — 4-е изд., пер. и доп. — Москва : Юрайт, 2024. — 585 с. — URL: <a href="https://urait.ru/bcode/532930">https://urait.ru/bcode/532930</a> (дата обращения: 22.04.2024). — Текст : электронный.	Онлайн

##### 6.1.3 Учебно-методические разработки (в т. ч. для самостоятельной работы обучающихся)

	Библиографическое описание	Кол-во экз. в библиотеке/ онлайн
6.1.3.1	Сольская, И.Ю. Методические указания по изучению дисциплины Б1.В.ДВ.13.02 Финансовый и валютный дилинг по направлению подготовки	Онлайн

	38.03.01 Экономика, профиль Финансы и кредит / И.Ю. Сольская ; ИрГУПС. – Иркутск : ИрГУПС, 2023. – 12 с. - Текст: электронный. - URL: <a href="https://www.irgups.ru/eis/for_site/umkd_files/mu_49105_1495_2024_1_signed.pdf">https://www.irgups.ru/eis/for_site/umkd_files/mu_49105_1495_2024_1_signed.pdf</a>
<b>6.2 Ресурсы информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»</b>	
<b>6.3 Программное обеспечение и информационные справочные системы</b>	
<b>6.3.1 Базовое программное обеспечение</b>	
6.3.1.1	Microsoft Windows Professional 10, государственный контракт от 20.07.2021 № 0334100010021000013-01
6.3.1.2	Microsoft Office Russian 2010, государственный контракт от 20.07.2021 № 0334100010021000013-01
6.3.1.3	FoxitReader, свободно распространяемое программное обеспечение <a href="http://free-software.com.ua/pdf-viewer/foxit-reader/">http://free-software.com.ua/pdf-viewer/foxit-reader/</a>
6.3.1.4	Adobe Acrobat Reader DC свободно распространяемое программное обеспечение <a href="https://get.adobe.com/ru/reader/enterprise/">https://get.adobe.com/ru/reader/enterprise/</a>
6.3.1.5	Яндекс. Браузер. Прикладное программное обеспечение общего назначения, Офисные приложения, лицензия – свободно распространяемое программное обеспечение по лицензии BSD License
<b>6.3.2 Специализированное программное обеспечение</b>	
6.3.2.1	Не предусмотрено
<b>6.3.3 Информационные справочные системы</b>	
6.3.3.1	Не предусмотрены
<b>6.4 Правовые и нормативные документы</b>	
6.4.1	Не предусмотрены

<b>7 ОПИСАНИЕ МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЙ БАЗЫ, НЕОБХОДИМОЙ ДЛЯ ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ УЧЕБНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ</b>	
1	Корпуса А, Б, В, Г, Д, Е ИрГУПС находятся по адресу г. Иркутск, ул. Чернышевского, д. 15; корпус Л ИрГУПС находится – по адресу г. Иркутск, ул. Лермонтова, д.80
2	Учебная аудитория Л-201 для проведения лекционных и практических занятий, лабораторных работ, групповых и индивидуальных консультаций, курсового проектирования (выполнения курсовых работ), текущего контроля и промежуточной аттестации. Основное оборудование: специализированная мебель
3	Учебная аудитория Л-202 для проведения лекционных и практических занятий, лабораторных работ, групповых и индивидуальных консультаций, курсового проектирования (выполнения курсовых работ), текущего контроля и промежуточной аттестации. Основное оборудование: специализированная мебель, мультимедиапроектор, экран, компьютер. Для проведения занятий имеются учебно-наглядные пособия (презентации, плакаты).
4	Помещения для самостоятельной работы обучающихся оснащены компьютерной техникой, подключенной к информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», и обеспечены доступом в электронную информационно-образовательную среду ИрГУПС. Помещения для самостоятельной работы обучающихся: – читальные залы; – учебные залы вычислительной техники А-401, А-509, А-513, А-516, Д-501, Д-503, Д-505, Д-507; – помещения для хранения и профилактического обслуживания учебного оборудования – А-521

<b>8 МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ</b>	
Вид учебной деятельности	Организация учебной деятельности обучающегося
Лекция	<p>Лекция (от латинского «lection» – чтение) – вид аудиторных учебных занятий. Лекция: закладывает основы научных знаний в систематизированной, последовательной, обобщенной форме; раскрывает состояние и перспективы развития соответствующей области науки и техники; концентрирует внимание обучающихся на наиболее сложных, узловых вопросах; стимулирует познавательную активность обучающихся.</p> <p>Во время лекционных занятий обучающийся должен уметь сконцентрировать внимание на изучаемых проблемах и включить в работу все виды памяти: словесную, образную и моторно-двигательную. Для этого весь материал, излагаемый преподавателем, обучающемуся необходимо конспектировать. На полях конспекта следует помечать вопросы, выделенные обучающимся для консультации с преподавателем. Выводы, полученные в виде формул, рекомендуется в конспекте подчеркивать или обводить рамкой, чтобы лучше запомнились. Полезно составить краткий справочник, содержащий определения важнейших понятий лекции. К каждому занятию следует разобрать материал</p>

	<p>предыдущей лекции. Изучая материал по учебнику или конспекту лекций, следует переходить к следующему вопросу только в том случае, когда хорошо усвоен предыдущий вопрос. Ряд вопросов дисциплины может быть вынесен на самостоятельное изучение. Такое задание требует оперативного выполнения. В конспекте лекций необходимо оставить место для освещения упомянутых вопросов. Обозначить вопросы, термины, материал, который вызывает трудности, пометить и попытаться найти ответ в рекомендуемой литературе. Если самостоятельно не удается разобраться в материале, то необходимо сформулировать вопрос и задать преподавателю на консультации, на практическом занятии</p>
<p>Практическое занятие</p>	<p>Практическое занятие – вид аудиторных учебных занятий, целенаправленная форма организации учебного процесса, при реализации которой обучающиеся по заданию и под руководством преподавателя выполняют практические задания. Практические задания направлены на углубление научно-теоретических знаний и овладение определенными методами работы, в процессе которых вырабатываются умения и навыки выполнения тех или иных учебных действий в данной сфере науки. Практические занятия развивают научное мышление и речь, позволяют проверить знания обучающихся, выступают как средства оперативной обратной связи; цель практических занятий – углублять, расширять, детализировать знания, полученные на лекции, в обобщенной форме и содействовать выработке навыков профессиональной деятельности.</p> <p>На практических занятиях подробно рассматриваются основные вопросы дисциплины, разбираются основные типы задач. К каждому практическому занятию следует заранее самостоятельно выполнить домашнее задание и выучить лекционный материал к следующей теме. Систематическое выполнение домашних заданий обязательно и является важным фактором, способствующим успешному усвоению дисциплины</p>
<p>Самостоятельная работа</p>	<p>Обучение по дисциплине «Финансовый и валютный дилинг» предусматривает активную самостоятельную работу обучающегося. В разделе 4 рабочей программы, который называется «Структура и содержание дисциплины», все часы самостоятельной работы расписаны по темам и вопросам, а также указана необходимая учебная литература: обучающийся изучает учебный материал, разбирает примеры и решает разноуровневые задачи в рамках выполнения как общих домашних заданий, так и индивидуальных домашних заданий (ИДЗ) и других видов работ, предусмотренных рабочей программой дисциплины. При выполнении домашних заданий обучающемуся следует обратиться к задачам, решенным на предыдущих практических занятиях, решенным домашним работам, а также к примерам, приводимым лектором. Если этого будет недостаточно для выполнения всей работы можно дополнительно воспользоваться учебными пособиями, приведенными в разделе 6.1 «Учебная литература». Если, несмотря на изученный материал, задание выполнить не удастся, то в обязательном порядке необходимо посетить консультацию преподавателя, ведущего практические занятия, и/или консультацию лектора.</p> <p>Домашние задания, индивидуальные домашние задания и другие работы, предусмотренные рабочей программой дисциплины должны быть выполнены обучающимся в установленные преподавателем сроки в соответствии с требованиями к оформлению текстовой и графической документации, сформулированным в Положении «Требования к оформлению текстовой и графической документации. Нормоконтроль»</p>
<p>Комплекс учебно-методических материалов по всем видам учебной деятельности, предусмотренным рабочей программой дисциплины (модуля), размещен в электронной информационно-образовательной среде ИрГУПС, доступной обучающемуся через его личный кабинет</p>	

# **Приложение № 1 к рабочей программе**

## **ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ**

**для проведения текущего контроля успеваемости  
и промежуточной аттестации**

## 1. Общие положения

Фонд оценочных средств (ФОС) является составной частью нормативно-методического обеспечения системы оценки качества освоения обучающимися образовательной программы.

Фонд оценочных средств предназначен для использования обучающимися, преподавателями, администрацией ИрГУПС, а также сторонними образовательными организациями для оценивания качества освоения образовательной программы и уровня сформированности компетенций у обучающихся.

Задачами ФОС являются:

- оценка достижений обучающихся в процессе изучения дисциплины;
- обеспечение соответствия результатов обучения задачам будущей профессиональной деятельности через совершенствование традиционных и внедрение инновационных методов обучения в образовательный процесс;
- самоподготовка и самоконтроль обучающихся в процессе обучения.

Фонд оценочных средств сформирован на основе ключевых принципов оценивания: валидность, надежность, объективность, эффективность.

Для оценки уровня сформированности компетенций используется трехуровневая система:

- минимальный уровень освоения, обязательный для всех обучающихся по завершению освоения образовательной программы; дает общее представление о виде деятельности, основных закономерностях функционирования объектов профессиональной деятельности, методов и алгоритмов решения практических задач;

- базовый уровень освоения, превышение минимальных характеристик сформированности компетенций; позволяет решать типовые задачи, принимать профессиональные и управленческие решения по известным алгоритмам, правилам и методикам;

- высокий уровень освоения, максимально возможная выраженность характеристик компетенций; предполагает готовность решать практические задачи повышенной сложности, нетиповые задачи, принимать профессиональные и управленческие решения в условиях неполной определенности, при недостаточном документальном, нормативном и методическом обеспечении.

## 2. Перечень компетенций, в формировании которых участвует дисциплина.

### Программа контрольно-оценочных мероприятий. Показатели оценивания компетенций, критерии оценки

Дисциплина «Финансовый и валютный дилинг» участвует в формировании компетенций:

ПК-2.2. Способен организовывать и поддерживать долгосрочные отношения со стратегическими партнерскими организациями (рейтинговыми агентствами, аудиторскими организациями, оценочными фирмами)

ПК-2.5. Способен давать комплексную консультацию клиентов по основным формам финансовых услуг, включая контроль подготовки и исполнения договоров и контрактов по направлениям деятельности в области финансового консультирования

#### Программа контрольно-оценочных мероприятий очная форма обучения

№	Наименование контрольно-оценочного мероприятия	Объект контроля	Код индикатора достижения компетенции	Наименование оценочного средства (форма проведения*)
<b>8 семестр</b>				
<b>1.0</b>	<b>Раздел 1. Базовые концепции финансового и валютного дилинга</b>			
1.1	Текущий контроль	Тема 1.1. Сущность, предмет и объект финансового дилинга. Генезис науки об управлении финансами. Ключевые концепции финансового и валютного дилинга.	ПК-2.2.2 ПК-2.5.2	Собеседование (устно)
1.2	Текущий контроль	Тема 1.2. Обзор источников информации о финансовом состоянии компании и качестве финансового управления	ПК-2.2.2 ПК-2.5.2	Разноуровневые задачи (задания/письменно) Собеседование (устно)
<b>2.0</b>	<b>Раздел 2. Формирование капитальных активов</b>			
2.1	Текущий контроль	Тема 2.1. Долевой капитал корпорации. Сущность и способы привлечения. Источники долевого капитала.	ПК-2.2.2 ПК-2.5.2	Разноуровневые задачи (задания/письменно) Собеседование (устно)
2.2	Текущий контроль	Тема 2.2. Долговой капитал корпорации. Сущность и способы привлечения. Источники долгового капитала.	ПК-2.2.2 ПК-2.5.2	Собеседование (устно) В рамках ПП**: Разноуровневые задачи (задания/письменно)
2.3	Текущий контроль	Тема 2.3. Модель оценки капитальных активов как основа методики анализа премии за риск.	ПК-2.2.2 ПК-2.5.2	Собеседование (устно) В рамках ПП**: Разноуровневые задачи (задания/письменно)
<b>3.0</b>	<b>Раздел 3. Операции финансового и валютного дилинга</b>			
3.1	Текущий контроль	Тема 3.1. Операции с валютными вкладами.	ПК-2.2.2 ПК-2.5.2	Разноуровневые задачи (задания/письменно) Собеседование (устно)
3.2	Текущий контроль	Тема 3.2. Конверсионные операции. Арбитраж.	ПК-2.2.2 ПК-2.5.2	Разноуровневые задачи (задания/письменно) Собеседование (устно)
3.3	Текущий контроль	Тема 3.3. Дилинг на Форекс. Спред. Своп.	ПК-2.2.2 ПК-2.5.2	Разноуровневые задачи (задания/письменно)
	Промежуточная аттестация	Раздел 1. Базовые концепции финансового и валютного дилинга Раздел 2. Формирование капитальных активов Раздел 3. Операции финансового и валютного дилинга	ПК-2.2.2 ПК-2.5.2	Зачет (собеседование) Зачет - тестирование (компьютерные технологии)

\*Форма проведения контрольно-оценочного мероприятия: устно, письменно, компьютерные технологии.

\*\*ПП – практическая подготовка

### Описание показателей и критериев оценивания компетенций.

#### Описание шкал оценивания

Контроль качества освоения дисциплины включает в себя текущий контроль успеваемости и промежуточную аттестацию. Текущий контроль успеваемости и промежуточная аттестация обучающихся проводятся в целях установления соответствия достижений обучающихся поэтапным требованиям образовательной программы к результатам обучения и формирования компетенций.

Текущий контроль успеваемости – основной вид систематической проверки знаний, умений, навыков обучающихся. Задача текущего контроля – оперативное и регулярное управление учебной деятельностью обучающихся на основе обратной связи и корректировки. Результаты оценивания учитываются в виде средней оценки при проведении промежуточной аттестации.

Для оценивания результатов обучения используется четырехбалльная шкала: «отлично», «хорошо», «удовлетворительно», «неудовлетворительно» и двухбалльная шкала: «зачтено», «не зачтено».

Перечень оценочных средств, используемых для оценивания компетенций, а также краткая характеристика этих средств приведены в таблице.

#### Текущий контроль

№	Наименование оценочного средства	Краткая характеристика оценочного средства	Представление оценочного средства в ФОС
1	Собеседование	Средство контроля на практическом занятии, организованное как специальная беседа преподавателя с обучающимся на темы, связанные с изучаемой дисциплиной, и рассчитанное на выяснение объема знаний обучающегося по определенному разделу, теме, проблеме и т.п. Может быть использовано для оценки знаний обучающихся	Вопросы для собеседования по темам/разделам дисциплины
2	Разноуровневые задачи (задания)	Различают задачи: – репродуктивного уровня, позволяющие оценивать и диагностировать знание фактического материала (базовые понятия, алгоритмы, факты) и умение правильно использовать специальные термины и понятия, узнавание объектов изучения в рамках определенного раздела дисциплины; может быть использовано для оценки знаний и умений обучающихся; – реконструктивного уровня, позволяющие оценивать и диагностировать умения синтезировать, анализировать, обобщать фактический и теоретический материал с формулированием конкретных выводов, установлением причинно-следственных связей; может быть использовано для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности обучающихся; – творческого уровня, позволяющие оценивать и диагностировать умения, интегрировать знания различных областей, аргументировать собственную точку зрения; может быть использовано для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности обучающихся	Комплект разноуровневых задач и заданий или комплекты задач и заданий определенного уровня

#### Промежуточная аттестация

№	Наименование оценочного средства	Краткая характеристика оценочного средства	Представление оценочного средства в ФОС
---	----------------------------------	--	---

1	Зачет	Средство, позволяющее оценить знания, умения, навыков и (или) опыта деятельности обучающегося по дисциплине. Может быть использовано для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности обучающихся	Перечень теоретических вопросов и практических заданий к зачету
2	Тест – промежуточная аттестация в форме зачета	Система автоматизированного контроля освоения компетенций (части компетенций) обучающимся по дисциплине (модулю) с использованием информационно-коммуникационных технологий. Может быть использовано для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности обучающихся	Фонд тестовых заданий

**Критерии и шкалы оценивания компетенций в результате изучения дисциплины при проведении промежуточной аттестации в форме зачета. Шкала оценивания уровня освоения компетенций**

Шкала оценивания	Критерии оценивания	Уровень освоения компетенции
«зачтено»	Обучающийся правильно ответил на теоретические вопросы. Показал отличные знания в рамках учебного материала. Правильно выполнил практические задания. Показал отличные умения и владения навыками применения полученных знаний и умений при решении задач в рамках учебного материала. Ответил на все дополнительные вопросы	Высокий
	Обучающийся с небольшими неточностями ответил на теоретические вопросы. Показал хорошие знания в рамках учебного материала. С небольшими неточностями выполнил практические задания. Показал хорошие умения и владения навыками применения полученных знаний и умений при решении задач в рамках учебного материала. Ответил на большинство дополнительных вопросов	Базовый
	Обучающийся с существенными неточностями ответил на теоретические вопросы. Показал удовлетворительные знания в рамках учебного материала. С существенными неточностями выполнил практические задания. Показал удовлетворительные умения и владения навыками применения полученных знаний и умений при решении задач в рамках учебного материала. Допустил много неточностей при ответе на дополнительные вопросы	Минимальный
«не зачтено»	Обучающийся при ответе на теоретические вопросы и при выполнении практических заданий продемонстрировал недостаточный уровень знаний и умений при решении задач в рамках учебного материала. При ответах на дополнительные вопросы было допущено множество неправильных ответов	Компетенция не сформирована

**Тест – промежуточная аттестация в форме зачета**

Шкала оценивания	Критерии оценивания
«зачтено»	Обучающийся верно ответил на 70 % и более тестовых заданий при прохождении тестирования
«не зачтено»	Обучающийся верно ответил на 69 % и менее тестовых заданий при прохождении тестирования

**Критерии и шкалы оценивания результатов обучения при проведении текущего контроля успеваемости**

## Собеседование

Шкалы оценивания		Критерии оценивания
«отлично»	«зачтено»	Глубокое и прочное усвоение программного материала. Полные, последовательные, грамотные и логически излагаемые ответы при видоизменении задания. Обучающийся свободно справляется с поставленными задачами, может обосновать принятые решения, демонстрирует владение разносторонними навыками и приемами выполнения практических работ
«хорошо»		Знание программного материала, грамотное изложение, без существенных неточностей в ответе на вопрос, правильное применение теоретических знаний, владение необходимыми навыками при выполнении практических задач
«удовлетворительно»		Обучающийся демонстрирует усвоение основного материала, при ответе допускаются неточности, при ответе недостаточно правильные формулировки, нарушение последовательности в изложении программного материала, затруднения в выполнении практических заданий Слабое знание программного материала, при ответе возникают ошибки, затруднения при выполнении практических работ
«неудовлетворительно»	«не зачтено»	Не было попытки выполнить задание

## Разноуровневые задачи (задания)

Шкалы оценивания		Критерии оценивания
«отлично»	«зачтено»	Демонстрирует очень высокий/высокий уровень знаний, умений, навыков в соответствии с критериями оценивания. Все требования, предъявляемые к заданию, выполнены
«хорошо»		Демонстрирует достаточно высокий/выше среднего уровень знаний, умений, навыков в соответствии с критериями оценивания. Все требования, предъявляемые к заданию, выполнены
«удовлетворительно»		Демонстрирует средний уровень знаний, умений, навыков в соответствии с критериями оценивания. Большинство требований, предъявляемых к заданию, выполнены. Демонстрирует низкий/ниже среднего уровень знаний, умений, навыков в соответствии с критериями оценивания. Многие требования, предъявляемые к заданию, не выполнены
«неудовлетворительно»	«не зачтено»	Демонстрирует очень низкий уровень знаний, умений, навыков в соответствии с критериями оценивания. Не ответа.

### 3. Типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности

#### 3.1 Типовые контрольные задания для проведения собеседования

Контрольные варианты заданий выложены в электронной информационно-образовательной среде ИрГУПС, доступной обучающемуся через его личный кабинет.

Ниже приведен образец типовых вариантов заданий для проведения собеседований.

Образец типового варианта вопросов для проведения собеседования

«Тема 1.1. Сущность, предмет и объект финансового дилинга. Генезис науки об управлении финансами. Ключевые концепции финансового и валютного дилинга.»

1. Предмет и объект финансового менеджмента
2. Инструменты финансового менеджмента
3. Генезис науки об управлении финансами.
4. Ключевые концепции финансового дилинга.
5. Концепция риска и доходности капитальных активов.

Образец типового варианта вопросов для проведения собеседования  
«Тема 1.2. Обзор источников информации о финансовом состоянии компании и качестве  
финансового управления»

1. Сущность и содержание финансовой отчетности
2. Бухгалтерский баланс
3. Отчет о финансовых результатах
4. Движение денежных средств. Финансовые потоки.
5. Финансовая отчетности (РСБУ).
6. Финансовая отчетность (МСФО)

Образец типового варианта вопросов для проведения собеседования  
«Тема 2.1. Долевой капитал корпорации. Сущность и способы привлечения. Источники  
 долевого капитала.»

1. Сущность и классификация долевого капитала.
2. Эмиссия акций.
3. Способы формирования собственного капитала.
4. Источники долевого капитала.
5. Цена источников долевого капитала.
6. Уставный (акционерный) капитал.

Образец типового варианта вопросов для проведения собеседования  
«Тема 2.2. Долговой капитал корпорации. Сущность и способы привлечения. Источники  
 долгового капитала.»

1. Структура и способы привлечения долгового капитала
2. Источники долгового капитала.
3. Долгосрочные источники долгового капитала
4. Цена источников долгового капитала
5. Цена и стоимость привлечения капитала

Образец типового варианта вопросов для проведения собеседования  
«Тема 2.3. Модель оценки капитальных активов как основа методики анализа премии за  
 риск.»

1. Финансовый риск
2. Структура капитала и факторы финансового риска
3. Понятие финансового рычага
4. Европейская концепция финансового рычага
5. Американская концепция финансового рычага

Образец типового варианта вопросов для проведения собеседования  
«Тема 3.1. Операции с валютными вкладами.»

1. Способы привлечения и финансовая сущность валютных вкладов.
2. Обеспечения возвратности валютных вкладов.
3. Страхование валютных вкладов
4. Валютный риск

Образец типового варианта вопросов для проведения собеседования  
«Тема 3.2 Конверсионные операции. Арбитраж.»

1. Российский валютный рынок: понятие, состояние, проблемы, перспективы развития.
2. Валютный дилинг как инструмент валютных отношений: понятие, сущность. Валютные дилеры (трейдеры): их роль, предназначение и цели деятельности.
3. Виды валютных рынков (валютные макторынки): особенности функционирования и их влияние друг на друга.

### 3.2 Типовые контрольные задания для решения разноуровневых задач (заданий)

Контрольные варианты заданий выложены в электронной информационно-образовательной среде ИрГУПС, доступной обучающемуся через его личный кабинет.

Ниже приведен образец типовых вариантов заданий для решения разноуровневых задач.

#### Образец заданий для решения разноуровневых задач

«Тема 1.2. Обзор источников информации о финансовом состоянии компании и качестве финансового управления»

Задание: рассчитать показатели эффективности финансового управления на основании данных публикуемой отчетности, провести факторный анализ рентабельности активов и рентабельности собственных средств по модели Du-Pont.

Показатель	Значение, млн. руб.		
	Период 1	Период 2	Период 3
Необоротные активы	14500	12300	25500
Оборотные активы, в том числе:	19300	15700	10400
- запасы	20%	25%	50%
- дебиторская задолженность	40%	25%	40%
- денежные средства	40%	50%	10%
Собственный капитал, в том числе:	20000	21400	22500
- нераспределенная прибыль	6200	5700	11350
Долгосрочные кредиты и займы	5500	6200	9400
Краткосрочные кредиты и займы	1100	310	540
Кредиторская задолженность	7200	90	3460
Выручка	35990	24550	48570
Расходы по обычным видам деятельности	13580	14220	17880
Сальдо прочих доходов и расходов	2600	5700	1300
Справочно: рыночная капитализация	45000	48000	91000

#### Образец заданий для решения разноуровневых задач

«Тема 2.1. Долевой капитал корпорации. Сущность и способы привлечения. Источники долевого капитала.»

Задание: Определить стоимость привлеченного капитала и вариант его наилучшей структуры, если:

ожидаемые дивиденды по привилегированным акциям составляют	ожидаемые дивиденды по обыкновенным акциям составляют	банковский кредит можно привлечь по ставке	затраты по размещению акций составляют	ставка налога на прибыль составляет
40 копеек с одной акции стоимостью 1 рубль	20 копеек с одной акции стоимостью 1 рубль	18 %;	0,3% от суммы эмиссии;	10%

#### Образец заданий для решения разноуровневых задач

«Тема 2.2. Долговой капитал корпорации. Сущность и способы привлечения. Источники долгового капитала.»

1. Выбрать оптимальный вариант финансирования бизнеса по критерию средневзвешенной стоимости капитала. Совокупная стоимость активов 25 млн. руб., все акции обыкновенные, заемный капитал – это банковский кредит, темп прироста дивиденда в ожидаемом периоде равен нулю.

Показатель	1 вар.	2 вар.	3 вар.	4 вар.	5 вар.
Отношение заемных средств к собственным	1,1	1,2	1,4	1,6	1,7
Выплаченные дивиденды, млн. руб.	3	2,7	2,5	2,3	2

Ставка по кредиту, %	21	22,5	23	24,5	25
----------------------	----	------	----	------	----

2. Рассчитать средневзвешенную стоимость капитала по приведенным данным. Проанализировать структуру капитала. Предложить управленческие решения, направленные на сокращение средневзвешенной стоимости капитала

Источник капитала	Капитал, тыс. руб.	Затраты на размещение, тыс. руб.	Выплаты инвесторам и кредиторам
Обыкновенные акции	248512	1458	74500 (темпы прироста дивидендов равен 0)
Привилегированные акции	50000	389	4500
Облигации	145845	2459	33520
Банковский кредит	471585	-	Процентная ставка – 21%

3. Капитал организации состоит из трех источников: обыкновенных и привилегированных акций и банковского кредита. Стоимость обыкновенных акций в обращении составляет 5400 млн. руб., привилегированных – 1150 млн. руб. по обыкновенным акциям выплачены дивиденды в размере 1080 млн. руб., темпы прироста дивидендов составляет 3% в год, по привилегированным выплачиваются дивиденды в размере 5% от номинала. Стоимость банковского кредита 4100 млн. руб. Необходимо проанализировать структуру источников капитала и обосновать процентную ставку по банковским кредитам, при которой средневзвешенная стоимость капитала не превысит 22%.

#### Образец заданий для решения разноуровневых задач

«Тема 2.3. Модель оценки капитальных активов как основа методики анализа премии за риск.»

Безрисковая доходность – 4%, Среднерыночная доходность - 16%. Провести расчет, какие акции следует приобрести.

Тикер	Цена "сегодня"	Цена через 1 год	Дивиденд	Коэффициент $\beta$
МММ	200	220	30	1,8
ННН	250	240	50	0,8
ООО	300	320	50	1,7
ААА	350	370	50	1,2

#### Образец заданий для решения разноуровневых задач

«Тема 3.1. Операции с валютными вкладами.»

Задания: На основании текста лекций по дисциплине «Финансовый и валютный дилинг», доступного обучающемуся через личный кабинет, оценить основные различия форвардных и фьючерсных валютных контрактов. Результаты для удобства можно представить в таблицу.

Основные различия форвардных и фьючерсных валютных контрактов	
Форвардные контракты	Фьючерсные контракты

#### Образец заданий для решения разноуровневых задач

«Тема 3.2 Конверсионные операции. Арбитраж.»

Задание: На основании текущих данных об операциях на валютной бирже, доступного обучающемуся через рекомендуемые информационные ресурсы (Центральный банк Российской Федерации // [Электронный ресурс] – Режим доступа: <http://www.cbr.ru/> Рабочей программы дисциплины) рассчитать кросс-курс канадского доллара и швейцарского франка – CAD/CHF.

## Образец заданий для решения разноуровневых задач

### «Тема 3.3. Дилинг на Форекс. Спред. Своп.»

Задания: На основании текущих данных об операциях на валютной бирже, доступного обучающемуся через рекомендуемые информационные ресурсы (Центральный банк Российской Федерации // [Электронный ресурс] – Режим доступа: <http://www.cbr.ru/> Рабочей программы дисциплины), оценить параметры текущих операций рынка Forex. Результаты для удобства можно представить в таблицу.

Название	Стандартное обозначение	Дата заключения	Дата валютирования	Период	Дата окончания

### 3.3 Типовые контрольные задания для проведения тестирования

Фонд тестовых заданий по дисциплине содержит тестовые задания, распределенные по разделам и темам, с указанием их количества и типа.

#### Структура фонда тестовых заданий по дисциплине

Индикатор достижения компетенции	Тема в соответствии с РПД	Характеристика ТЗ	Количество тестовых заданий, типы ТЗ
ПК-2.2.2 ПК-2.5.2	Тема 1.1. Сущность, предмет и объект финансового дилинга. Генезис науки об управлении финансами. Ключевые концепции финансового и валютного дилинга.	Знания	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Умения	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
ПК-2.2.2 ПК-2.5.2	Тема 1.2. Обзор источников информации о финансовом состоянии компании и качестве финансового управления	Знания	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Умения	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
ПК-2.2.2 ПК-2.5.2	Тема 2.1. Долевой капитал корпорации. Сущность и способы привлечения. Источники долевого капитала.	Знания	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Умения	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
ПК-2.2.2 ПК-2.5.2	Тема 2.2. Долговой капитал корпорации. Сущность и способы привлечения. Источники долгового капитала.	Знания	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Навыки или опыт практической деятельности	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
ПК-2.2.2 ПК-2.5.2	Тема 2.3. Модель оценки капитальных активов как основа методики анализа премии за риск.	Знания	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Навыки или опыт практической деятельности	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
ПК-2.2.2 ПК-2.5.2	Тема 3.1. Операции с валютными вкладами.	Знания	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Умения	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
ПК-2.2.2 ПК-2.5.2	Тема 3.2 Конверсионные операции. Арбитраж.	Знания	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Умения	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
ПК-2.2.2 ПК-2.5.2	Тема 3.3. Дилинг на Форекс. Спред. Своп.	Знания	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Умения	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Итого	48 – ОТЗ 32 – ЗТЗ

Полный комплект ФТЗ хранится в электронной информационно-образовательной среде ИрГУПС и обучающийся имеет возможность ознакомиться с демонстрационным вариантом ФТЗ.

Ниже приведен образец типового варианта итогового теста, предусмотренного рабочей программой дисциплины.

1. Что называется «валютным рынком»?

**а) Национальные и международные банки, а также биржи, через которые осуществляется покупка, продажа и обмен иностранной валюты**

б) Согласованная, координированная валютная политика и система внешних расчетов

2. Выбрать инструменты, относящиеся к основному валютному инструментарию:

**А) мировой Forex,**

**Б) рублевый Forex,**

В) форвард,

Г) своп-операции

3. Определите, что такое «валютный клиринг»?

а) Вид долгосрочного лизинга

**б) Система расчетов, основанная на взаимном зачете обязательств**

в) Операции по обмену товаров, не сопровождаются денежными переводами

г) Система расчетов между участниками

4. Как определяется стоимость свободно конвертируемой валюты?

**а) По официальному курсу**

б) По покупательной способности

в) товарным наполнением

г) По спросом и предложением

5. «Рынок евродолларов» — это:

а) Организации — кредиторы европейской промышленности в долларах США

б) Европейский валютный банк и его операции в долларах США

в) Рынок обмена валюты США в Европе

**г) Операции кредитно-финансовых учреждений европейских стран в долларах США**

6. Какие валюты имеют статус резервных?

а) Вольно конвертируемые валюты

**б) Доллары США**

**в) Швейцарские франки**

г) Денежные единицы любой страны

7. Какие методы валютного котирования сегодня используются?

а) Метод «потребительской корзины»

**б) Метод золотого паритета**

**в) Метод прямой и обратной котировки**

г) Сопоставление покупательной способности валют

8. Определите, какая из перечисленных характеристик не относится к кредитному риску:

1) риск того, что заемщик не оплатит по ссуде;

2) вероятность того, что стоимость части активов фирмы, а особенно кредитов, уменьшится или сведется к нулю или фактическая доходность по данной части активов окажется значительно ниже ожидаемого уровня;

3) вероятность невозврата кредитов;

**4) риск того, что цена активов упадет из-за роста нормы процента;**

5) вероятность значительных убытков по кредитам и другим активам вследствие невыполнения заемщиком своих обязательств.

9. Определите, что такое обесценивание курса национальной валюты в форме снижения ее курса (цены) в отношении иностранных валют, международных расчетных денежных единиц (ранее — золота):

- а) Ревальвация
- б) Валютная интервенция
- в) Девальвация**
- г) Политика валютных ограничений

10. В отчетном периоде значение коэффициента текущей ликвидности составило 0,25, а текущие финансовые потребности отрицательны. Как можно интерпретировать такие результаты анализа отчетности? Какие управленческие решения следует предпринять?

Ответ: учитывается полнота ответа

11. Рассчитать средневзвешенную стоимость капитала, если стоимость всех обыкновенных акций составила 4800 тыс. руб., затраты на размещение обыкновенных акций 50 тыс. руб., стоимость привилегированных акций 3100 тыс. руб., затраты на размещение 120 тыс. руб., по обыкновенным акциям выплачены дивиденды в сумме 500 тыс. руб., по привилегированным — 590 тыс. руб., стоимость банковских кредитов — 8100 тыс. руб., средняя процентная ставка 17,3% (действующая ставка налога на прибыль).

Ответ: число (41%)

12. Представьте схему форфейтинговой сделки

Ответ: учитывается полнота ответа

13. Представьте схему арбитражной сделки

Ответ: учитывается полнота ответа

14. Валютный своп: суть, предназначение.

Ответ: учитывается полнота ответа

15. Для каждого из приведенных понятий подберите соответствующее определение

1. Золотой паритет	а) Соизмерение средневзвешенного курса одной валюты по отношению к определенному набору других валют.
2. Валютный паритет	б) Соотношение двух валют по их покупательной способности.
3. Паритет покупательной способности	в) Соотношение валют по их официальному золотому содержанию
4. Валютная корзина	г) Соотношение между двумя валютами, устанавливаемое в законодательном порядке

Ответы: 1 – в; 2 – г; 3 – б; 4 – а

16. Установите соответствие между основными элементами и их классификацией

1. мировая валютная система	а) официальные золотые и валютные резервы страны;
2. национальная валютная система	б) регламентация режимов валютных курсов;
3. международная валютная ликвидность	в) регламентация использования международных кредитных средств обращения;
	г) унификация правил основных форм международных расчетов;
	д) условия конвертируемости национальной валюты.

Ответ: 1 – г; 2 – а; 3 - д

17. Установите правильную последовательность этапов осуществления аккредитивной формы расчетов:

- а) Авизующий банк передает аккредитив бенефициару, удостоверяя его подлинность;
- б) Импортер после заключения контракта с экспортером представляет в банк заявление на открытие аккредитива;

- в) Авирующий банк посылает документы для оплаты банку-эмитенту;
  - г) Банк –эмитент открывает аккредитив и направляет его своему корреспонденту, как правило, в стране экспортера, поручая ему авизовать аккредитив бенефициару;
  - д) После получения в пользу бенефициара аккредитива он производит отгрузку товара;
  - е) Бенефициар представляет документы как правило, в авирующий банк;
  - ж) После проверке правильности оформления документов, банк-эмитент переводит деньги.
- Ответ: б, г, а, в, ж, д

18. По результатам анализа отчетности сделан вывод о критическом падении уровня коммерческой маржи. Какие этапы финансового управления и в какой последовательности могут быть направлены на оптимизацию данного показателя?

Ответ: учитывается полнота ответа

### **3.4 Перечень теоретических вопросов к зачету**

(для оценки знаний)

1. Что называется «валютным рынком»?
2. Национальные и международные банки
3. Биржевые операции покупки, продажи и обмена иностранной валюты
4. Мировой Forex,
5. Рублевый Forex,
6. Форвард,
7. Своп-операции
8. Валютный клиринг
9. Как определяется стоимость свободно конвертируемой валюты
10. «Рынок евродолларов»
11. Резервные валюты
12. Методы валютной котировки
13. Метод «потребительской корзины»\
14. Метод золотого паритета
15. Метод прямой и обратной котировки
16. Обесценивание курса национальной валюты
17. Валютная интервенция
18. Политика валютных ограничений
19. Валютный опцион
20. Валютный фьючерс

### **3.5 Перечень типовых простых практических заданий к зачету**

(для оценки умений)

1. Установите правильную последовательность определения кросс-курса монгольского тугра к российскому рублю.
2. Установите правильную последовательность этапов осуществления аккредитивной формы расчетов:

### **3.6 Перечень типовых практических заданий к зачету**

(для оценки навыков и (или) опыта деятельности)

1. На основании текущих данных об операциях на валютной бирже, доступного обучающемуся через рекомендуемые информационные ресурсы ( Центральный банк Российской Федерации // [Электронный ресурс] – Режим доступа: <http://www.cbr.ru/> Рабочей программы дисциплины), оценить параметры текущих операций рынка Forex. Результаты для удобства можно представить в таблицу.

Название	Стандартное обозначение	Дата заключения	Дата валютирования	Период	Дата окончания

**2.** На основании рекомендуемой литературы по дисциплине «Финансовый и валютный дилинг», оценить основные различия форвардных и фьючерсных валютных контрактов. Результаты для удобства можно представить в таблицу.

Основные различия форвардных и фьючерсных валютных контрактов	
Форвардные контракты	Фьючерсные контракты

#### 4. Методические материалы, определяющие процедуру оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности

В таблице приведены описания процедур проведения контрольно-оценочных мероприятий и процедур оценивания результатов обучения с помощью оценочных средств в соответствии с рабочей программой дисциплины.

Наименование оценочного средства	Описания процедуры проведения контрольно-оценочного мероприятия и процедуры оценивания результатов обучения
Собеседование	Собеседование, предусмотренное рабочей программой дисциплины, проводится на практическом занятии. Преподаватель на практическом занятии, предшествующем занятию проведения контроля, доводит до обучающихся тему, вопросы для подготовки к собеседованию. Результаты собеседования преподаватель доводит до обучающихся сразу после завершения собеседования
Разноуровневая задача (задание)	Выполнение разноуровневых задач (заданий), предусмотренных рабочей программой дисциплины, проводятся во время практических занятий. Во время выполнения задач (заданий) разрешается пользоваться учебниками, справочниками, конспектами лекций, тетрадями для практических занятий

Для организации и проведения промежуточной аттестации составляются 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.

Перечень теоретических вопросов и типовые практические задания разного уровня сложности для проведения промежуточной аттестации обучающиеся получают в начале семестра через электронную информационно-образовательную среду ИрГУПС (личный кабинет обучающегося).

##### Описание процедур проведения промежуточной аттестации в форме зачета и оценивания результатов обучения

При проведении промежуточной аттестации в форме зачета преподаватель может воспользоваться результатами текущего контроля успеваемости в течение семестра. С целью использования результатов текущего контроля успеваемости, преподаватель подсчитывает среднюю оценку уровня сформированности компетенций обучающегося (сумма оценок, полученных обучающимся, делится на число оценок).

##### Шкала и критерии оценивания уровня сформированности компетенций в результате изучения дисциплины при проведении промежуточной аттестации в форме зачета по результатам текущего контроля (без дополнительного аттестационного испытания)

Средняя оценка уровня сформированности компетенций по результатам текущего контроля	Шкала оценивания
Оценка не менее 3,0 и нет ни одной неудовлетворительной оценки по текущему контролю	«зачтено»
Оценка менее 3,0 или получена хотя бы одна неудовлетворительная оценка по текущему контролю	«не зачтено»

Если оценка уровня сформированности компетенций обучающегося не соответствует критериям получения зачета без дополнительного аттестационного испытания, то промежуточная аттестация проводится в форме собеседования по перечню теоретических вопросов и типовых практических задач или в форме компьютерного тестирования.

Промежуточная аттестация в форме зачета с проведением аттестационного испытания проходит на последнем занятии по дисциплине.

При проведении промежуточной аттестации в форме компьютерного тестирования вариант тестового задания формируется из фонда тестовых заданий по дисциплине случайным

образом, но с условием: 50 % заданий должны быть заданиями открытого типа и 50 % заданий – закрытого типа.