

до наказу від _____ 2021 р. № _____

**НАЦІОНАЛЬНИЙ УНІВЕРСИТЕТ БІОРЕСУРСІВ І
ПРИРОДОКОРИСТУВАННЯ УКРАЇНИ**

Кафедра банківської справи та страхування

«ЗАТВЕРДЖУЮ»

Декан економічного факультету

д.е.н., проф. _____ Діброва А.Д.

«__» червня 2021 р.

«СХВАЛЕНО»

на засіданні кафедри банківської справи та страхування

Протокол № __ від «__» червня 2021 р.

Завідувач кафедри

д.е.н., проф. _____ Худолій Л.М.

«РОЗГЛЯНУТО»

Гарант ОП _____

Гарант ОП

_____ (ПІБ гаранта)

РОБОЧА ПРОГРАМА НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

ВАЛЮТНО-КРЕДИТНІ ТА РОЗРАХУНКОВІ БАНКІВСЬКІ ОПЕРАЦІЇ

(назва навчальної дисципліни)

Спеціальність

072 Фінанси, банківська справа та страхування

(шифр і назва спеціальності)

Освітня програма

Банківська справа

(назва спеціалізації)

Факультет

Економічний

(назва факультету)

Розробники:

доцент, к.е.н. Бронін О.В.

(посада, науковий ступінь, вчене звання)

1. Опис навчальної дисципліни

Валютно-кредитні та розрахункові банківські операції

| Галузь знань, спеціальність, освітня програма, освітній ступінь | | |
|--|---|-----------------------|
| Освітній ступінь | Бакалавр | |
| Спеціальність | 072 Фінанси, банківська справа та страхування | |
| Освітня програма | Банківська справа | |
| Характеристика навчальної дисципліни | | |
| Вид | Вибіркова | |
| Загальна кількість годин | 150 | |
| Кількість кредитів ECTS | 5 | |
| Кількість змістових модулів | 2 | |
| Курсовий проект (якщо є в робочому навчальному плані) | X | |
| Форма контролю | Екзамен | |
| Показники навчальної дисципліни для денної та заочної форм навчання | | |
| | денна форма навчання | заочна форма навчання |
| Рік підготовки | | |
| Семестр | | |
| Лекційні заняття | 30 год. | 15 год. |
| Практичні, семінарські заняття | 45 год. | 20 год. |
| Лабораторні заняття | | |
| Самостійна робота | 75 год. | 115 год. |
| Індивідуальні завдання | | |
| Кількість тижневих аудиторних годин для денної форми навчання | | |

2. Мета, завдання та компетентності навчальної дисципліни

Мета: формування у студентів системи теоретичних знань з питань функціонування валютного ринку та оволодіння практичними навичками проведення валютно-кредитних та розрахункових банківських операцій.

Завдання: зрозуміти суть та значення валютного ринку в сфері економічних відносин; ознайомитись з теорією функціонування і розвитку світової валютної системи; систематизувати такі категорії як «валюта», «валютний ринок», «міжнародні розрахунки», «валютні операції»; вивчити типи, види та форми міжнародних розрахунків; знати нормативно-правові акти щодо функціонування валютного ринку в Україні; вміти ідентифікувати валютні ризики та організовувати лінії захисту в процесі управління валютними ризиками; опанувати технології проведення конверсійних, депозитних, форвардних і ф'ючерсних операцій, опціонів, свопів; оволодіти практичними навичками укладання валютних угод за допомогою дилінгового обладнання Reuters і Укрдилінг; набути практичного досвіду з ведення обліку валютних операцій в Автоматизованій банківській системі Б2.

У результаті вивчення навчальної дисципліни студент повинен:

- **знати:** сутність та функції таких категорій, як «валюта», «валютний ринок», «міжнародні розрахунки», «валютні операції»; еволюцію функціонування і розвитку світової валютної системи; зміст основних теорій регулювання валютного курсу; типи, види та форми міжнародних розрахунків, особливості їх застосування; нормативно-правову базу та систему регулювання валютного ринку в Україні; технологію проведення валютних операцій.
- **вміти:** вільно використовувати теоретичні знання в процесі роботи на валютному ринку; здійснювати конверсійні, депозитні, кредитні, форвардні та ф'ючерсні операції, опціони, свопи; укладати валютні угоди за допомогою дилінгового обладнання Reuters і Укрдилінг; вести облік валютних операцій в Автоматизованій банківській системі Б2.

Набуття компетентностей:

- **загальні компетентності (ЗК):** ЗК1, ЗК3, ЗК4, ЗК5, ЗК6, ЗК7, ЗК9.
- **фахові (спеціальні) компетентності (ФК):** СК1, СК2, СК3, СК4, СК5, СК7, СК8.

3. Програма та структура навчальної дисципліни для:

- повного терміну денної (заочної) форми навчання;
- скороченого терміну денної (заочної) форми навчання.

Змістовий модуль 1. Економічний зміст валютного ринку і міжнародних розрахунків.

Тема лекційного заняття 1. Сутність і функції валютного ринку, його роль в економіці.

Сутність і функції валютного ринку, його роль в економіці. Учасники валютного ринку. Структура валютного ринку. Валюта та валютні цінності. Конвертованість валют та валютний курс. Валютна позиція. Світова валютна система та її еволюція. Паризька система золотомонетного стандарту. Генуезька система золотодевізного стандарту. Бреттон-Вудська валютна система. Кінгстонська (Ямайська) валютна система. Валютні блоки і зони. Валютний союз ЄС. Теорії регулювання валютного курсу.

Тема лекційного заняття 2. Міжнародні розрахунки.

Економічні основи міжнародних розрахунків. Валютно-фінансові та платіжні умови міжнародних операцій. Типи, види та форми міжнародних розрахунків. Аванс. Акредитив. Інкасо. Банківський переказ. Розрахунки з використанням векселів і чеків. Розрахунки за відкритими рахунками. Консигнація. Розрахунки з використанням пластикових карток. Ризики при міжнародних розрахунках та методи їх мінімізації.

Тема лекційного заняття 3. Основи організації валютних відносин в Україні.

Етапи становлення валютного ринку України. Нормативно-правове забезпечення функціонування валютного ринку в Україні. Основні терміни на валютному ринку України: валюта України, іноземна валюта, валютні операції, резиденти, нерезиденти. Порядок організації торгівлі та розрахунків на валютному ринку України. Функції державних органів і банківської системи України у сфері валютного контролю. Відповідальність за порушення валютного законодавства. Порядок відкриття, використання і закриття рахунків у національній та іноземних валютах. Порядок та умови торгівлі іноземною валютою. Валютний ринок України в умовах фінансової кризи. Регулювання валютного ринку в умовах кризи.

Тема лекційного заняття 4. Нове валютне регулювання в Україні.

Передумови лібералізації валютного законодавства в Україні. Нормативно-правові акти, які є основою для нової системи валютного регулювання. Які валютні послаблення чекають на бізнес та населення. Як спроститься валютний контроль. Як Національний банк наглядатиме за банками. Як банки наглядатимуть за клієнтськими операціями. Дорожня карта подальшого скасування валютних обмежень.

Тема лекційного заняття 5. Інструменти хеджування валютних ризиків бізнесу.

Хеджувати чи ні? Який валютний ризик найчастіше хеджують. Інструменти хеджування. Нормативно-правове регулювання валютних операцій на умовах «форвард». Практика використання форвардів в Україні. А яка частка форвардних операцій в світі? Формула розрахунку форвардного курсу. Міфи щодо вітчизняного хеджування. Актуальні питання щодо використання форвардів.

Змістовий модуль 2. Технології проведення валютних операцій.

Тема лекційного заняття 6. Конверсійні операції.

Загальна характеристика конверсійних операцій. Валютні операції на умовах спот. Дата валютування. Валютний курс. Процес встановлення валютного курсу. Базисні пункти. Пряме і непряме котирування. Курси Bid і Offer. Спред. Крос-курси та їх розрахунок. Валютна позиція банку. Види валютної позиції. Відкрита і закрита валютна позиція. Коротка відкрита і довга відкрита валютна позиція. Ліміти відкритої валютної позиції.

Тема лекційного заняття 7. Депозитні та кредитні операції.

Загальна характеристика депозитних операцій. Залучення та розміщення коштів. Види депозитів за строками. Дні укладення угод, дата валютування та дата закінчення. Відсоткові ставки. Формула простого відсотка. Методи нарахування відсотків за кількістю днів у році. Сторони Bid і Offer та розмір маржі в котируванні відсоткових ставок. Депозитна позиція і відсотковий арбітраж. Міжбанківські і клієнтські депозити.

Тема лекційного заняття 8. Форвардні та ф'ючерсні операції, опціони, свопи.

Загальна характеристика форвардних операцій. Форвардний курс. Використання форвардних контрактів з метою мінімізації ризиків. Прибуток (збиток) за форвардним контрактом. Валютні ф'ючерси. Валютні свопи. Валютні опціони. Валютний арбітраж.

Тема лекційного заняття 9. Укладання угод за допомогою дилінгового обладнання Reuters і Укрдилінг.

Загальне ознайомлення зі структурою сервісів Reuters і Укрдилінг. Специфіка ведення переговорів за допомогою Reuters (ключові слова, загальноживані скорочення). Порядок укладання та підтвердження депозитних угод (розміщення, залучення, пролонгація депозитів). Порядок укладання та підтвердження конверсійних угод.

Тема лекційного заняття 10. Облік валютних операцій в Автоматизованій банківській системі Б2.

Загальне ознайомлення з функціональною структурою АБС Б2. Підсистеми для автоматизації угод по наданню й залученню ресурсів на міжбанківському ринку; угод по покупці, продажу або конверсії на міжбанківському валютному ринку; банкотних операцій по покупці/продажу наявних коштів за безготівкові.

Структура навчальної дисципліни

| Назви змістових модулів і тем | Кількість годин | | | | | | | | | | | |
|--|-----------------|--------------|-----------|-----|-----|-----------|--------------|--------------|-----------|-----|-----|------------|
| | денна форма | | | | | | Заочна форма | | | | | |
| | усього | у тому числі | | | | | усього | у тому числі | | | | |
| | | л | п | лаб | інд | с.р. | | л | п | лаб | інд | с.р. |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 10 | 11 | 12 | 13 |
| Змістовий модуль 1. Економічний зміст валютного ринку і міжнародних розрахунків | | | | | | | | | | | | |
| Тема 1. Сутність і функції валютного ринку, його роль в економіці | 14 | 3 | 4 | | | 7 | 15 | 1,5 | 2 | | | 11,5 |
| Тема 2. Міжнародні розрахунки | 14 | 3 | 4 | | | 7 | 15 | 1,5 | 2 | | | 11,5 |
| Тема 3. Основи організації валютних відносин в Україні | 14 | 3 | 4 | | | 7 | 15 | 1,5 | 2 | | | 11,5 |
| Тема 4. Нове валютне регулювання в Україні | 16 | 3 | 5 | | | 8 | 15 | 1,5 | 2 | | | 11,5 |
| Тема 5. Інструменти хеджування валютних ризиків бізнесу | 16 | 3 | 5 | | | 8 | 15 | 1,5 | 2 | | | 11,5 |
| Разом за змістовим модулем 1 | 74 | 15 | 22 | | | 37 | 75 | 7,5 | 10 | | | 57,5 |
| Змістовий модуль 2. Технології проведення валютних операцій | | | | | | | | | | | | |
| Тема 6. Конверсійні операції | 16 | 3 | 5 | | | 8 | 15 | 1,5 | 2 | | | 11,5 |
| Тема 7. Депозитні та кредитні операції | 16 | 3 | 5 | | | 8 | 15 | 1,5 | 2 | | | 11,5 |
| Тема 8. Форвардні та ф'ючерсні операції, опціони, свопи | 16 | 3 | 5 | | | 8 | 15 | 1,5 | 2 | | | 11,5 |
| Тема 9. Укладання угод за допомогою дилінгового обладнання Reuters і Укрдилінг | 14 | 3 | 4 | | | 7 | 15 | 1,5 | 2 | | | 11,5 |
| Тема 10. Облік валютних операцій в Автоматизованій банківській системі Б2 | 14 | 3 | 4 | | | 7 | 15 | 1,5 | 2 | | | 11,5 |
| Разом за змістовим модулем 2 | 76 | 15 | 23 | | | 38 | 75 | 7,5 | 10 | | | 57,5 |
| Усього годин | 150 | 30 | 45 | | | 75 | 150 | 15 | 20 | | | 115 |

4. Теми семінарських занять

| № з/п | Назва теми | Кількість годин |
|-------|---|-----------------|
| 1 | Сутність і функції валютного ринку, його роль в економіці | 4 |
| 2 | Міжнародні розрахунки | 4 |
| 3 | Основи організації валютних відносин в Україні | 4 |
| 4 | Нове валютне регулювання в Україні | 5 |
| 5 | Інструменти хеджування валютних ризиків бізнесу | 5 |

5. Теми практичних занять

| № з/п | Назва теми | Кількість годин |
|-------|--|-----------------|
| 1 | Конверсійні операції | 5 |
| 2 | Депозитні операції | 5 |
| 3 | Форвардні та ф'ючерсні операції, опціони, свопи | 5 |
| 4 | Укладання угод за допомогою дилінгового обладнання Reuters і Укрдилінг | 4 |
| 5 | Облік валютних операцій в Автоматизованій банківській системі Б2 | 4 |

6. Теми лабораторних занять

| № з/п | Назва теми | Кількість годин |
|-------|------------|-----------------|
| | | |

7. Контрольні питання, комплекти тестів для визначення рівня засвоєння знань студентами

1. Дайте визначення поняття «валютний ринок».
2. За якими критеріями класифікують валютні ринки?
3. Назвіть основних учасників та інструменти світового валютного ринку.
4. Що слід розуміти під терміном "валюта"?
5. Які валюти торгуються на регіональному валютному ринку?
6. Назвіть характерні риси національного валютного ринку.
7. Які функції виконують валютні ринки?
8. Назвіть основних учасників валютного ринку. Які їх функції, цілі?
9. Як організована торгівля на міжбанківському валютному ринку?
10. Як організована торгівля на біржовому валютному ринку?
11. Назвіть біржі, які торгують іноземною валютою.
12. Дайте характеристику сучасних світових валютно-фінансових центрів і поясніть їх появу.

13. Які фактори сприяють зростанню обсягів спекулятивних операцій на валютному ринку?

14. Як розвиток інформаційних технологій впливає на розвиток валютного ринку?

15. Дайте визначення поняття "валютний курс".

16. Назвіть види режимів валютного курсу.

17. Чим відрізняються поняття "пряме котирування" і "непряме котирування" валюти?

18. Дайте визначення поняття "крос-курс". Які існують способи розрахунку крос-курсу?

19. У чому відмінність "курсу продавця" від "курсу покупця" валюти?

20. Чим відрізняються поняття "спред" і "маржа"?

21. Дайте визначення поняття "фіксинг". У чому сутність механізму фіксингу на валютному ринку?

22. Назвіть основні групи факторів, що впливають на валютний курс.

23. Які фактори призводять до підвищення валютного курсу? Охарактеризуйте наслідки підвищення валютного курсу для різних груп учасників ринку.

24. Які фактори призводять до зниження валютного курсу? Охарактеризуйте наслідки зниження валютного курсу для різних груп учасників ринку.

25. Дайте визначення поняття "валютна позиція". Які види валютної позиції існують?

26. До якого результату призведе підвищення курсу валюти, в якій є коротка валютна позиція?

27. До якого результату призведе зниження курсу валюти, в якій є довга валютна позиція?

28. З якою метою може підтримуватися відкрита валютна позиція?

29. З якою метою встановлюють ліміти відкритих валютних позицій?

30. Дайте визначення світової валютної системи.

31. Які характерні риси Паризької системи золотого стандарту?

32. Охарактеризуйте Генуезьку систему золотодевізного стандарту.

33. Назвіть головні особливості світової валютної кризи 1929-1933 рр.

34. Проаналізуйте хід підготовки та підписання Бреттон-Вудської валютно фінансової угоди.

35. Назвіть основні принципи функціонування Бреттон-Вудської валютної системи.

36. Коли розпочалися криза і розпад Бреттон-Вудської системи?

37. Охарактеризуйте основні положення Кінгстонської валютної системи.

38. Що таке валютний блок? Які економічні передумови його утворення?

39. Охарактеризуйте стерлінговий, доларовий та золотий валютні блоки.

40. Які основні економічні ознаки валютної зони?

41. Назвіть найбільш характерні риси стерлінгової, доларової валютних зон та зони французького франка.

42. Яка була мета створення Європейської валютної системи?

43. Назвіть основні етапи переходу до Європейського економічного і валютного союзу (ЄВС).

44. Охарактеризуйте позиції окремих країн ЄС щодо введення єдиної валюти євро.

45. Коли було створено Європейський центральний банк (ЄЦБ)?

46. Назвіть вимоги, що ставляться до фінансово-економічних показників країн, які бажають приєднатися до зони євро.

47. Охарактеризуйте перспективи співпраці України з країнами зони євро.

48. Дайте визначення поняття «міжнародні розрахунки. Які види міжнародних розрахунків існують?

49. Назвіть основні принципи організації міжнародних розрахункових операцій.

50. Охарактеризуйте особливості міжнародних розрахунків.

51. Опишіть валютно-фінансові умови міжнародних розрахунків.

52. Назвіть основні форми розрахунків.

53. Назвіть способи платежів за міжнародними розрахунками.

54. Опишіть ризики, які притаманні міжнародним розрахункам.

55. Дайте характеристику зовнішньоекономічного контракту.

56. Опишіть ключові розділи зовнішньоекономічного контракту.

57. Що собою являє валютне застереження контракту? В яких випадках його використовують?

58. Що таке ІНКОТЕРМС? Які основні групи умов ІНКОТЕРМС?

59. Поясніть особливості авансових розрахунків.

60. Охарактеризуйте платежі на відкритий рахунок. Назвіть переваги та недоліки для імпортера і експортера.

61. Опишіть роль банківського переказу в міжнародних розрахунках.

62. В чому переваги для міжнародних контрагентів в розрахунках за допомогою системи SWIFT?

63. Опишіть особливості розрахунків з використанням векселів.

64. Дайте характеристику розрахункових операцій з використанням платіжних карток.

65. Що таке акредитив та які його основні форми та види? У яких випадках доцільно використовувати відкличні, а у яких безвідкличні акредитив?

66. Які акредитиви є покритими, а які непокритими? В чому суть валютного покриття?

67. В чому відмінності акредитивів і гарантій? Чому резервний акредитив ототожнюють з банківською гарантією?

68. В чому суть фінансової та комерційної моделі акредитива «стенд-бай»?

69. Назвіть переваги та недоліки використання резервного акредитива для продавця та покупця?

70. Які умови платежу повинні бути зазначені при використанні експортного акредитива?

71. Яке значення в міжнародних розрахунках відіграє банківське підтвердження акредитива?

72. Назвіть види інкасо та особливості їх використання в міжнародних розрахунках. В чому відмінність між чистим та документарним інкасо?

73. Яка послідовність здійснення операцій з документарного інкасо?

74. В чому суть та особливості використання Уніфікованих правил для інкасо та акредитивів?

75. Які особливості та специфіка використання документарного інкасо в міжнародних розрахунках, на відміну від документарних акредитивів Ви знаєте?

76. Опишіть ключові етапи акредитивної форми розрахунків.

77. Яким документом регламентується порядок використання міжнародних гарантій?

78. Дайте характеристику відзивної та безвідзивної, умовної та безумовної гарантії.

79. Поясніть, чим відрізняються платіжні гарантії від контрактних.

80. Назвіть види контрактних гарантій.

81. В чому суть та необхідність застосування дистанційного банківського обслуговування? Які переваги для клієнтів?

82. Які етапи можна виділити в розвитку валютного ринку України?

83. Де в Україні здійснювалися торги іноземною валютою та валютними цінностями до 1999 року?

84. Назвіть основних учасників валютного ринку України.

85. Як встановлюється офіційний валютний курс?

86. Як розвивалося регулювання українського валютного ринку?

87. Як називаються банки, яким надано право на проведення валютних операцій?

88. Чи мають право підприємства - резиденти України відкривати рахунки в іноземній валюті за кордоном?

89. Які фактори стримують розвиток строкового валютного ринку України?

90. Назвіть основні види валютних операцій.

91. Як на курс національної валюти впливає дефіцит платіжного балансу держави?

92. Назвіть причини обмеження використання іноземної валюти як засобу платежу на території України.

93. Визначте та дайте характеристику ризикам при торгівлі валютою.

94. Які види лімітів застосовуються до валютних операцій?

95. Які Ви знаєте методи управління валютним ризиком?

96. Дайте характеристику торговельним та неторговельним операціям в іноземній валюті.

97. Які питання в обов'язковому порядку відображені в Генеральній угоді про встановлення кореспондентських відносин.

98. Порядок проведення операцій банків із розрахунково-касового обслуговування клієнтів в іноземній валюті.

99. Що таке «кореспондентський рахунок»?

100. Що таке «валютний рахунок»?

101. Валютні обмеження в Україні та їх вплив на ефективність експортно-імпортних операцій.

102. Ідентифікація клієнта – це необхідність чи ні?
103. Які фактори стали передумовою для запровадження нової ліберальної системи валютного регулювання в Україні?
104. Які валютні послаблення чекають на бізнес та населення з 7 лютого 2019 року?
105. Як спроститься валютний контроль в рамках нової системи валютного регулювання?
106. Як Національний банк змінить нагляд за банками у сфері валютних операцій?
107. Чи будуть штрафи за порушення валютного законодавства за новою системою валютного регулювання більш м'якими?
108. Як банки наглядатимуть за клієнтськими операціями?
109. Чи послаблюються вимоги законодавства щодо запобігання і протидії відмиванню коштів в рамках нової системи валютного регулювання?
110. Які валютні обмеження можуть бути скасовані в майбутньому?
111. Хеджувати чи ні валютний ризик?
112. Який валютний ризик найчастіше хеджують?
113. Назвіть інструменти хеджування.
114. Якими нормативно-правовими актами регламентуються валютні операції на умовах «форвард»?
115. Наскільки широка практика використання форвардів в Україні?
116. А яка частка форвардних операцій в світі?
117. Розпишіть формулу розрахунку форвардного курсу.
118. Які міфи існують щодо вітчизняного хеджування?
119. Курс яких валют можна хеджувати за допомогою форварду?
120. Обмежуючи ризики, я обмежую і свій потенційний додатковий прибуток?
121. Якщо я вигідно купив або продав валюту на форварді, то хто тоді програв і отримав збиток?
122. Чим поставочний форвард відрізняється від безпоставочного?
123. Як банки беруть на себе ризики за форвардними контрактами? Чи достатньо в них для цього ресурсів?
124. На яку максимальну суму я можу укласти форвардний контракт?
125. Якщо я продав валюту на форварді по 25, а курс продовжує зростати і вже перевищив 28 – чи є можливість відмовитися від форвардного контракту?
126. Як гарантується виконання банком і клієнтом своїх зобов'язань за форвардним контрактом?
127. Чому хеджувати краще ніж не хеджувати?
128. Поясніть суть конверсійних операцій.
129. Дайте визначення поняттю "дата валютування".
130. Дайте порівняльну характеристику спотовому та форвардному ринку.
131. Які особливості валютних операцій на умовах спот?
132. Дайте визначення поняття «валютний курс» та опишіть процес його встановлення.
133. Поясніть суть прямого та зворотного котирування.

134. Опишіть процедуру котирування валютних курсів банками з використанням сторін bid і offer.

135. Дайте визначення поняття «крос-курс» та опишіть порядок розрахунку крос-курсів.

136. Дайте визначення поняття «валютна позиція банку» та опишіть її різновиди.

137. Що таке відкрита позиція трейдера?

138. Дайте визначення короткої і довгої позиції.

139. Що таке загальна відкрита позиція трейдера?

140. Чи правильне твердження, що довга загальна відкрита позиція трейдера вказує на потенційний прибуток?

141. Якою операцією (купівлею або продажем) можна закрити коротку відкриту позицію трейдера?

142. Дайте класифікацію валютного ринку, ґрунтуючись на характеристиці валютних інструментів.

143. Назвіть основні валютні інструменти ринку термінових валютних операцій.

144. Що таке короткий і форвардний аутрайт?

145. Дайте визначення конверсійного свопу.

146. Чи правильне твердження, що ринок поточних конверсійних операцій – це ринок конверсій з датою валютування спот?

147. Які основні параметри конверсійної операції спот обговорюють уповноважені трейдери при укладанні угоди?

148. Які параметри конверсійної угоди можуть бути уточнені після укладання угоди?

149. Що таке пряме і непряме котирування?

150. Як розрахувати крос-котирування сторони Bid і Ask на основі прямих доларових котирувань відповідних валют?

151. Як розрахувати крос-котирування сторони Bid і Ask на основі прямого і непрямого доларових котирувань відповідних валют?

152. Як розрахувати крос-котирування сторони Bid і Ask на основі непрямих доларових котирувань відповідних валют?

153. Що означає ціна Bid і Ask для маркет-мейкера?

154. Чим визначається величина маржі при призначенні ціни конверсійної операції?

155. При якому значенні крос-котирування відсутня арбітражна різниця?

156. При яких значеннях крос-котирування операції з крос-валютами стають непривабливими для контрагентів?

157. Як в режимі маркет-мейкера зменшити коротку відкриту позицію трейдера?

158. Як в режимі маркет-мейкера зменшити довгу відкриту позицію контрагента?

159. Чим визначається розмір маржі при встановленні спот-котирувань?

160. Яка дата валютування для поточних конверсійних операцій характерна для валютного ринку України?

161. Назвіть декілька валют, для яких прийнято використовувати зворотне доларове котирування?

162. Що означають сленгові вирази "піпси" і "велика фігура" стосовно конверсійних котирувань?

163. Чому дорівнює пункт і маржа конверсійного котирування спот на міжнародному міжбанківському ринку?

164. Якими характерними сумами угод оперують на міжнародному міжбанківському ринку?

165. Розкрийте суть депозитних валютних операцій.

166. Визначте процедуру валютування депозитних операцій.

167. Дайте характеристику процентних ставок на ринку міжбанківських депозитів в іноземній валюті.

168. Розкрийте суть депозитної позиції та відсоткового арбітражу.

169. Котирування процентних ставок. Сторони котирування.

170. Що таке депозитна позиція?

171. Дайте визначення поняття "ринок євровалют".

172. Визначте зв'язок між процентними ставками та валютними курсами.

173. Що означає котирування: USD 3m 6.11 – 6.20 %?

174. Дайте визначення строкових валютних операцій.

175. Що таке "форвардна маржа"? Від чого залежить її величина?

176. У чому відмінність валютного форвардного контракту від валютного ф'ючерсного контракту?

177. Які строкові інструменти обертаються в Україні?

178. Ким і з якою метою використовуються строкові валютні інструменти?

179. У чому сутність угоди "своп"? Які види валютних свопів існують? Назвіть цілі їх використання.

180. У чому сутність валютного арбітражу? Охарактеризуйте його основні види.

181. Які види ризиків виникають при проведенні валютних операцій?

182. Дайте визначення поняття "валютний ризик". Назвіть причини його виникнення.

183. Які методи управління валютним ризиком існують?

184. Які методи управління валютним ризиком найчастіше використовуються банками?

185. Які методи управління валютним ризиком найчастіше використовуються експортерами (імпортерами)?

186. У чому сутність хеджування валютного ризику терміновими валютними інструментами?

187. Які основні параметри форвардної операції обговорюють уповноважені трейдери при висновку операції?

188. Якою послідовністю операцій можна замінити форвардну операцію?

189. Як розраховується дата валютування форвардних операцій з терміном аутрайт, кратних місяцю?

190. Чим обумовлена відповідність стандартних термінів аутрайт стандартним термінам депозитів?

191. Як розрахувати курс купівлі і продажу для форвардних аутрайтів?
192. Як розрахувати курс купівлі і продажу для коротких аутрайтів?
193. Що таке форвардні пункти і форвардні диференціали?
194. Що визначає відмінність в розрахунках курсів коротких і форвардних аутрайтів?
195. У чому вимірюються форвардні диференціали?
196. При якому значенні форвардних диференціалів відсутня арбітражна різниця?
197. При якому значенні форвардних диференціалів форвардні операції стають непривабливими? Чому?
198. Чи правильне твердження, що розрахункові значення форвардних і своп-пунктів рівні?
199. Як розраховуються форвардні крос-курси?
200. Як розрахувати форвардні курси для ламаних дат?
201. Яким способом ведуться переговори при укладенні угод з використанням дилінгової апаратури Reuters?
202. Хто з контрагентів, що укладають угоду, за допомогою апаратури Reuters виступає маркет-мейкером? Чому?
203. Чи можливо після ключових слів “Купую” або “Продаю” скасувати угоду?
204. Чи допустимо відмовлятися від угоди, не підтверджуючи факт отримання згоди покупки або продажу?
205. Чи є відсутність платіжних інструкцій в тексті переговорів підставою для розриву угоди?
206. Які варіанти запиту валютного котирування спот Ви знаєте?
207. Які варіанти валютного котирування спот можна одержати від контрагента?
208. Що означає курс Bid і Ask для маркет-юзера? Для маркет-мейкера?
209. Хто з контрагентів, що укладають угоду, за допомогою апаратури Reuters виступає маркет-мейкером? Чому?
210. Чи може маркет-мейкер котирувати курс купівлі більше, ніж курс продажу?
211. Назвіть основні ризики при проведенні дилінгових операцій.
212. Хто з контрагентів, що укладають угоду за допомогою апаратури Reuters, виступає маркет-юзером? Чому?
213. Що таке ризик ліквідності?
214. Які ризики покликаний обмежити денний ліміт відкритої позиції трейдера?
215. Які ризики обмежує ліміт відкритої позиції контрагента?
216. Чи може сумарний обсяг операцій з контрагентом перевищувати значення ліміту відкритої позиції контрагента без його порушення?
217. Що таке ліміт загальної короткої відкритої позиції трейдера?
218. Які ризики обмежує ліміт загальної короткої відкритої позиції?
219. У якій валюті указується ліміт загальної короткої відкритої позиції? Чому?

220. Чи існує залежність між величиною денного ліміту відкритої позиції і оптимальним значенням ліміту загальної відкритої короткої позиції?

221. Як впливає величина відкритої позиції трейдера на вірогідність порушення ліміту збитків?

222. Як в режимі маркет-юзера зменшити коротку відкриту позицію трейдера?

223. Як в режимі маркет-юзера зменшити довгу відкриту позицію контрагента?

224. Чи переноситься відкрита позиція трейдера на наступний торговий день?

225. У яких випадках відкрита позиція контрагента закривається?

226. Чи змінюється величина відкритої позиції трейдера в базовій валюті при зміні ринкової ціни?

227. З яким максимальним обсягом можна укласти операцію без порушення ліміту контрагента?

228. На підставі яких міркувань призначається ліміт відкритої позиції контрагента?

229. Чи можна при укладенні угод управляти позиціями за рахунками НОСТРО?

8. Методи навчання

Лекції, демонстрація за допомогою PowerPoint, практичні заняття, індивідуальні завдання.

9. Форми контролю

У процесі викладання предмету використовується три види контролю: поточний, модульний і підсумковий.

Поточний контроль включає в себе:

- тестування (т) – така форма контролю проводиться регулярно на вибірковій основі і дозволяє перевірити підготовку студентів до кожного заняття;

- розв'язування задач (рз) – така форма контролю проводиться на окремих заняттях і дозволяє перевірити знання основних положень заданої теми, формувати логічне мислення студентів;

- опитування (о) – така форма контролю проводиться регулярно на вибірковій основі з метою виявлення вміння студентами оперувати матеріалом, вичитаним викладачем, відповідати на додаткові питання;

- індивідуальні завдання (із) – така форма контролю проводиться з метою формування вмінь і навичок у студентів практичного спрямування, формування сучасного мислення, вміння приймати відповідальні та ефективні рішення;

- самостійна робота (ср) – така форма контролю дозволяє виявити вміння студента чітко, логічно і послідовно відповідати на поставлені запитання, вміння працювати самостійно;

- контрольна робота (кр) – така форма контролю проводиться з метою отримання загального уявлення про достатність взаємозв'язку «викладач-студент» з даної дисципліни, а також контролю та поточної успішності.

Модульний контроль здійснюється під час виконання контрольної роботи, яка проводиться у формі тестів, і передбачає рейтингову оцінку знань, умінь і навичок студентів за окремими змістовими модулями та їх елементами.

Підсумковий контроль проводиться у вигляді екзамену при умові проходження студентом усіх етапів поточного і модульного контролю.

10. Розподіл балів, які отримують студенти

Оцінювання знань студента відбувається за 100-бальною шкалою і переводиться в національні оцінки згідно з табл. 1 «Положення про екзамени та заліки у НУБіП України» (наказ про уведення в дію від 27.12.2019 р. № 1371).

| Рейтинг студента, бали | Оцінка національна за результати складання | |
|---------------------------|---|---------------|
| | екзаменів | заліків |
| 90-100 | Відмінно | Зараховано |
| 74-89 | Добре | |
| 60-73 | Задовільно | |
| 0-59 | Незадовільно | Не зараховано |

Для визначення рейтингу студента (слухача) із засвоєння дисципліни $R_{\text{дис}}$ (до 100 балів) одержаний рейтинг з атестації (до 30 балів) додається до рейтингу студента (слухача) з навчальної роботи $R_{\text{НР}}$ (до 70 балів): $R_{\text{дис}} = R_{\text{НР}} + R_{\text{ат}}$.

11. Методичне забезпечення

1. Аврамчук Л.А., Жарікова О.Б. Міжнародні кредитно-розрахункові та валютні операції: навчально-методичні рекомендації для самостійного вивчення дисципліни для студентів денної форми навчання / Л.А. Аврамчук, О.Б. Жарікова. – К. – 2010. – 96 с.
2. Калівошко О.М., Жарікова О.Б. Міжнародні кредитно-розрахункові та валютні операції: методичні рекомендації до вивчення дисципліни для студентів всіх форм навчання / О.М. Калівошко, О.Б. Жарікова. – Чернігів, «ТЕХ-ТЕК Прес, 2013. – 30 с.

12. Рекомендована література

Основна

1. Губарева І.О. Міжнародні розрахунки і валютні операції: конспект лекцій / І.О. Губарева. - Х.: Харк. нац. екон. ун-т, 2006. - 128 с.
2. Міжнародні розрахунки та валютні операції: навч. посіб. Т.С. Шемет, А.М. Коряк, О.М. Діба. - К.: Київ. нац. екон. ун-т ім. В. Гетьмана, 2009. - 348 с.
3. Мілай А.О. Міжнародні кредитно-розрахункові та валютні операції: навч. посіб. / А.О. Мілай. - К. : Міжрег. акад. упр. персоналом 2007.-384 с.

4. Руденко Л.В. Міжнародні кредитно-розрахункові і валютні операції: підруч. для студ. вищ. навч. закл. / Л.В. Руденко. - К. : Центи учбової книги, 2003. - 616 с.
5. Шевчук І.М. Міжнародні розрахунки і валютні операції: навч.- метод. посіб. / І.М. Шевчук. - Л. : Львів, комерц. акад., 2004. - 147 с.

Допоміжна

1. Закон України. Про банки і банківську діяльність. [Електронний ресурс]. – Режим доступу: <https://zakon.rada.gov.ua/laws/show/2121-14#Text>
2. Закон України. Про валюту і валютні операції. [Електронний ресурс]. – Режим доступу: <https://zakon.rada.gov.ua/laws/show/2473-19#Text>
3. Положення про структуру валютного ринку України, умови та порядок торгівлі іноземною валютою та банківськими металами на валютному ринку України. - Затверджено постановою Правління Національного банку України від 02.01.2019 № 1. [Електронний ресурс]. – Режим доступу: <https://zakon.rada.gov.ua/laws/show/v0001500-19#Text>
4. Положення про здійснення операцій із валютними цінностями. – Затверджено постановою Правління Національного банку України від 02.01.2019 № 1. [Електронний ресурс]. – Режим доступу: <https://zakon.rada.gov.ua/laws/show/v0002500-19#Text>
5. Положення про організацію системи управління ризиками в банках України та банківських групах. - Затверджено постановою Правління Національного банку України від 11.06.2018 № 64. [Електронний ресурс]. – Режим доступу: <https://zakon.rada.gov.ua/laws/show/v0064500-18>

13. Інформаційні ресурси

1. <http://bank.gov.ua/>
2. <http://rada.gov.ua/>
3. <http://finance.ua/>
4. <http://www.prostobankir.com.ua/>
5. <http://www.prostobank.ua>