

Документ подписан простой электронной подписью  
Информация о владельце:  
ФИО: Антипова Наталья Викторовна  
Должность: и.о. директора филиала  
Дата подписания: 21.09.2024 14:49:12  
Уникальный программный ключ:  
fae5412acb1bf810dc69e6bc004ac45622b84b3a

Приложение 6  
к основной профессиональной образовательной программе  
по направлению подготовки 38.03.01 Экономика  
направленность (профиль) программы  
«Финансы и кредит»

**Министерство науки и высшего образования Российской Федерации  
федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение  
высшего образования  
«Российский экономический университет имени Г.В. Плеханова»  
Улан-Баторский филиал РЭУ им. Г.В. Плеханова**



Одобрено  
на заседании Совета Улан-Баторского  
филиала РЭУ им. Г.В. Плеханова  
протокол № 08 от «25» апреля 2024г.  
Председатель совета  
Н.В. Антипова

**ОЦЕНОЧНЫЕ МАТЕРИАЛЫ**

по дисциплине **Валютная система**

|   |                           |
|---|---------------------------|
| <b>Направление подготовки</b>             | <b>38.03.01 Экономика</b> |
| <b>Направленность (профиль) программы</b> | <b>Финансы и кредит</b>   |
| <b>Уровень высшего образования</b>        | <b>Бакалавриат</b>        |

**Год начала подготовки 2024**

Улан-Батор – 2024 г.

Оценочные материалы одобрены на заседании междисциплинарной кафедры  
10.04.2024 г. протокол № 9

## ОЦЕНОЧНЫЕ МАТЕРИАЛЫ

по дисциплине «Валютная система»

### ПЕРЕЧЕНЬ КОМПЕТЕНЦИЙ С УКАЗАНИЕМ РЕЗУЛЬТАТОВ ОБУЧЕНИЯ И ЭТАПОВ ИХ ФОРМИРОВАНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

| Формируемые компетенции<br>(код и наименование компетенции)  | Индикаторы достижения компетенций<br>(код и наименование индикатора)   | Результаты обучения (знания, умения)  | Наименование контролируемых разделов и тем |
|--|--|---|--|
| ПК-1. Способен осуществлять мониторинг конъюнктуры рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, иностранной валюты, товарно-сырьевых рынков | ПК-1.1. Проводит исследование финансового рынка и изучает предложения финансовых услуг (в том числе действующих правил и условий, тарифной политики и действующих форм документации) | ПК-1.И-1.3-1. Знает конъюнктуру и механизмы функционирования финансовых рынков<br>ПК-1.И-1.3-2. Знает основы формирования и структуру современной финансовой системы, историю ее развития; подходы к определению структуры финансового рынка и оценки его конъюнктуры<br>ПК-1.И-1.3-3. Знает характеристики финансовых продуктов и услуг, в т.ч. базовые банковские, страховые и инвестиционные продукты и услуги<br>ПК-1.И-1.3-4. Знает систему розничных финансовых услуг, применяемых при управлении личными финансами домохозяйств (инвестиционные, кредитные, страховые, пенсионные), их качественные, количественные характеристики<br>ПК-1.И-1.3-5. Знает основные мировые и российские тенденции изменения законодательства, регулирующего финансовую деятельность<br>ПК-1.И-1.У-1. Умеет | Темы 1 - 5                                 |

|   |   |  |                   |
|---|---|--|-------------------|
|   |   | <p>анализировать особенности современной государственной финансовой политики Российской Федерации, анализировать актуальные проблемы и направления развития российской и мировой финансовой системы</p> <p>ОПК-1.И-1.У-2 Умеет давать оценку составу, структуре и эффективности использования инструментов финансового рынка, производить информационно-аналитическую работу по рынку финансовых продуктов и услуг</p> <p>ОПК-1.И-1.У-3. Умеет мыслить системно, структурировать информацию для принятия управленческих решений в сфере финансов</p> |                   |
| <p>ПК-4. Способен выявлять, анализировать и оценивать экономические и финансовые риски компаний, органов власти, населения, риски функционирования национальных и международных финансовых рынков</p> | <p>ПК-4.1. Анализирует и оценивает различные виды финансовых рисков в разрезе отдельных видов деятельности субъектов макро- и микро-уровней, рисков функционирования национальных и международных финансовых систем и финансовых рынков</p> | <p>ПК-4. И-1.3-1. Знает источники получения данных о состоянии финансовой системы, сегментов финансового рынка для выявления, анализа и оценки потенциальных финансовых рисков экономических агентов.</p> <p>ПК-4.И-1.3-2. Знает методы анализа и оценки рисков с позиции их идентификации по функциональным областям</p> <p>ПК-4. И-1.У-1. Умеет проводить анализ различных рисков в зависимости от целей и в разрезе отдельных видов риска на основе установленных</p>   | <p>Темы 1 - 5</p> |

|  |  |  |  |
|--|--|--|--|
|  |  | <p>методических принципов и подходов.</p> <p>ПК-4. И-1.У-2. Умеет осуществлять количественную и качественную оценку уровня (пороговых значений, условных зон) рисков в разрезе отдельных видов деятельности хозяйствующих субъектов, направлений функционирования звеньев финансовой системы и сегментов финансового рынка.</p> <p>ПК-4. И-1.У-3. Умеет разрабатывать отдельные функциональные направления управления рисками</p> <p>ПК-4.И-1.У-4. Умеет отбирать подходящие методы воздействия на отдельные виды рисков и эффективно применять их с учетом их результативности и экономической эффективности.</p> <p>ПК-4.И-1.У-5. Умеет осуществлять расчеты, прогнозировать, тестировать и верифицировать методики управления рисками с учетом отраслевой специфики</p> |  |
|--|--|--|--|

## МЕТОДИЧЕСКИЕ МАТЕРИАЛЫ, ХАРАКТЕРИЗУЮЩИЕ ЭТАПЫ ФОРМИРОВАНИЯ КОМПЕТЕНЦИЙ

Перечень учебных заданий на аудиторных занятиях \_\_\_\_\_

Задания для текущего контроля \_\_\_\_\_

Задания для творческого рейтинга \_\_\_\_\_

\_\_\_\_\_

# МЕТОДИЧЕСКИЕ МАТЕРИАЛЫ, ХАРАКТЕРИЗУЮЩИЕ ЭТАПЫ ФОРМИРОВАНИЯ КОМПЕТЕНЦИЙ ВО ВРЕМЯ ПРОВЕДЕНИЯ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ

## Структура зачетного задания

| <i>Наименование оценочного средства</i>              | <i>Максимальное количество баллов</i> |
|--|---------------------------------------|
| <i>Вопрос 1</i>                                      | <i>10</i>                             |
| <i>Вопрос 2</i>                                      | <i>15</i>                             |
| <i>Практическое задание (расчетно-аналитическое)</i> | <i>15</i>                             |

## Задания, включаемые в зачетное задание

### *Типовой перечень вопросов к зачету:*

1. Понятие и значение международных валютно-финансовых отношений.
2. Понятие, классификация валютной системы.
3. Эволюция валютной системы.
4. Характеристика элементов национальной валютной системы.
5. Характеристика элементов мировой валютной системы.
6. Факторы валютной системы.
7. Сущность и теории валютного курса.
8. Валютный рынок: суть и функции.
9. Классификация валютных рынков.
10. Структура валютного рынка.
11. Участники валютного рынка.
12. Виды валютных курсов.
13. Валютная система и режимы курсообразования.
14. Эволюция политики курсообразования российского рубля.
15. Конвертируемость национальной валюты: понятие и виды, условия повышения.
16. Конвертируемость российского рубля.
17. Рыночное и государственное регулирование валютных отношений: понятие, цели.
18. Формы государственного валютного регулирования.
19. Валютная система и валютная политика: взаимосвязь.
20. Факторы валютного курса.
21. Ключевые факторы курсообразования российского рубля.
22. Понятие и функции валютного рынка.
23. Структура валютного рынка.
24. Участники валютных отношений.
25. Валюта и валютные ценности.
26. Влияние валютной политики Банка России на динамику валютного курса российского рубля.
27. Виды валютных рисков.
28. Государственное управление валютными рисками.
29. Валютная политика Банка России на современном этапе.
30. Характеристика мирового валютного рынка.
31. Текущий и срочный валютный рынок.
32. Биржевой и внебиржевой валютный рынок.
33. Особенности структуры российского валютного рынка.

34. Характеристика ключевых элементов валютной системы Российской Федерации.  
 35. Взаимосвязь между состоянием валютной системой Российской Федерации и валютной политикой Банка России.

**Типовые расчетно-аналитические задания/задачи:**

1. Предприятие последовательно заключает контракты на приобретение 40 тыс. долл., на продажу 30 тыс. долл., на продажу 25 тыс. долларов. Какой позицией по доллару будет обладать предприятие после этого? Какую прибыль (убыток) оно получит при росте курса доллара с 62,0 руб. за доллар до 62,8 руб. за доллар?  
 2. Предприятие последовательно заключает контракты на приобретение 20 тыс. долл., на приобретение 40 тыс. долл., на продажу 35 тыс. долларов. Какой позицией по доллару будет обладать предприятие после этого? Какую прибыль (убыток) оно получит при росте курса доллара с 65,0 руб. за доллар до 66,6 руб. за доллар?  
 3. Предприятие последовательно заключает контракты на приобретение 35 тыс. долл., на продажу 50 тыс. долл., на приобретение 60 тыс. долларов. Какой позицией по доллару будет обладать предприятие после этого? Какую прибыль (убыток) оно получит при снижении курса доллара с 67,0 руб. за доллар до 66,4 руб. за доллар?  
 4. Курсы покупки и продажи составляют:

| Валюта | Курс покупки, долл. | Курс продажи, долл. |
|--------|---------------------|---------------------|
| Франк  | 1,0201              | 1,0252              |
| Фунт   | 1,4346              | 1,4458              |

- Какая сумма в франках потребуется лицу, пожелавшему купить 2000 фунтов?  
 5. Курс евро/ российский рубль составляет 76,0136, курс доллар/ рубль – 66,4408; курс франк/доллар – 1,0099; курс франк /йена – 116,06. Определить курс евро к йене.  
 6. Курс валютной пары GBP/USD составляет 1,4504. Курсовая маржа равна 0,3%. Определить комиссию в абсолютном и относительном выражении и курсы покупки/продажи GBP/USD.  
 7. Российская компания заключила контракт на экспорт своей продукции по цене 300 евро. за единицу. На российском рынке аналогичная продукция реализуется по цене 24000 руб. за единицу. По оценкам экспертов на момент оплаты продукции курс евро будет составлять от 79,65 до 81,05 руб. за евро (любые значения в этом интервале равновероятны). Какова вероятность того, что компания понесет курсовые убытки?  
 8. Курс доллар/евро составляет 0,8126, курс евро/рубль - 75,05. Каков будет курс доллар/рубль при росте курса доллар/евро на 3% и снижении курса евро/рубль на 1 %.  
 9. Текущий курс доллара США составляет 60 руб. за доллар, текущий курс евро – 75 руб. за евро. Определить курс доллара к евро в прямой котировке после 10% ревальвации доллара.  
 10. Текущий курс доллара США составляет 65 руб. за доллар, текущий курс евро – 73 руб. за евро. Определить курс доллара к евро в косвенной котировке после 20% девальвации доллара.

**Показатели и критерии оценивания планируемых результатов освоения компетенций и результатов обучения,  
шкала оценивания**

Таблица 5

| Шкала оценивания |           | Формируемые компетенции   | Индикатор достижения компетенции   | Критерии оценивания   | Уровень освоения компетенций |
|------------------|-----------|---|--|---|------------------------------|
| 85 – 100 баллов  | «зачтено» | ПК-1 Способен осуществлять мониторинг конъюнктуры рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, иностранной валюты, товарно-сырьевых рынков       | ПК-1.1. Проводит исследование финансового рынка и изучает предложения финансовых услуг (в том числе действующих правил и условий, тарифной политики и действующих форм документации)           | <p><b>Знает верно и в полном объеме:</b><br/>конъюнктуру и механизмы функционирования финансовых рынков; основы формирования и структуру современной финансовой системы, историю ее развития; подходы к определению структуры финансового рынка и оценки его конъюнктуры;<br/>характеристики финансовых продуктов и услуг, в т.ч. базовые банковские, страховые и инвестиционные продукты и услуги;<br/>систему розничных финансовых услуг, применяемых при управлении личными финансами домохозяйств (инвестиционные, кредитные, страховые, пенсионные), их качественные, количественные характеристики;<br/>основные мировые и российские тенденции изменения законодательства, регулирующего финансовую деятельность</p> <p><b>Умеет верно и в полном объеме:</b><br/>анализировать особенности современной государственной финансовой политики Российской Федерации, анализировать актуальные проблемы и направления развития российской и мировой финансовой системы;<br/>давать оценку составу, структуре и эффективности использования инструментов финансового рынка, производить информационно-аналитическую работу по рынку финансовых продуктов и услуг;<br/>мыслить системно, структурировать информацию для принятия управленческих решений в сфере финансов</p> | Продвинутый                  |
|                  |           | ПК-4. Способен выявлять, анализировать и оценивать экономические и финансовые риски компаний, органов власти, населения, риски функционирования | ПК-4.1. Анализирует и оценивает различные виды финансовых рисков в разрезе отдельных видов деятельности субъектов макро- и микро-уровней, рисков функционирования национальных и международных | <p><b>Знает верно и в полном объеме:</b><br/>источники получения данных о состоянии финансовой системы, сегментов финансового рынка для выявления, анализа и оценки потенциальных финансовых рисков экономических агентов;<br/>методы анализа и оценки рисков с позиции их идентификации по функциональным областям</p> <p><b>Умеет верно и в полном объеме:</b><br/>проводить анализ различных рисков в зависимости от целей и в разрезе отдельных видов риска на основе установленных методических принципов и подходов;</p>  |                              |



|                   |           |   |  |   |            |
|-------------------|-----------|---|--|---|------------|
|                   |           | национальных и международных финансовых рынков  | финансовых систем и финансовых рынков  | осуществлять количественную и качественную оценку уровня (пороговых значений, условных зон) рисков в разрезе отдельных видов деятельности хозяйствующих субъектов, направлений функционирования звеньев финансовой системы и сегментов финансового рынка;<br>разрабатывать отдельные функциональные направления управления рисками; отбирать подходящие методы воздействия на отдельные виды рисков и эффективно применять их с учетом их результативности и экономической эффективности;<br>осуществлять расчеты, прогнозировать, тестировать и верифицировать методики управления рисками с учетом отраслевой специфики   |            |
| 70 – 84<br>баллов | «зачтено» | ПК-1 Способен осуществлять мониторинг конъюнктуры рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, иностранной валюты, товарно-сырьевых рынков | ПК-1.1. Проводит исследование финансового рынка и изучает предложения финансовых услуг (в том числе действующих правил и условий, тарифной политики и действующих форм документации) | <b>Знает с незначительными замечаниями:</b><br>конъюнктуру и механизмы функционирования финансовых рынков; основы формирования и структуру современной финансовой системы, историю ее развития; подходы к определению структуры финансового рынка и оценки его конъюнктуры;<br>характеристики финансовых продуктов и услуг, в т.ч. базовые банковские, страховые и инвестиционные продукты и услуги;<br>систему розничных финансовых услуг, применяемых при управлении личными финансами домохозяйств (инвестиционные, кредитные, страховые, пенсионные), их качественные, количественные характеристики;<br>основные мировые и российские тенденции изменения законодательства, регулирующего финансовую деятельность<br><b>Умеет с незначительными замечаниями:</b><br>анализировать особенности современной государственной финансовой политики Российской Федерации, анализировать актуальные проблемы и направления развития российской и мировой финансовой системы;<br>давать оценку составу, структуре и эффективности использования инструментов финансового рынка, производить информационно-аналитическую работу по рынку финансовых продуктов и услуг;<br>мыслить системно, структурировать информацию для принятия управленческих решений в сфере финансов | Повышенный |
|                   |           | ПК-4. Способен выявлять, анализировать и оценивать экономические и финансовые риски компаний, органов власти, населения,                  | ПК-4.1. Анализирует и оценивает различные виды финансовых рисков в разрезе отдельных видов деятельности субъектов макро- и микро-уровней, рисков функционирования                    | <b>Знает с незначительными замечаниями:</b><br>источники получения данных о состоянии финансовой системы, сегментов финансового рынка для выявления, анализа и оценки потенциальных финансовых рисков экономических агентов;<br>методы анализа и оценки рисков с позиции их идентификации по функциональным областям<br><b>Умеет с незначительными замечаниями:</b>   |            |

|                |           |   |  |   |                |
|----------------|-----------|---|--|---|----------------|
|                |           | риски функционирования национальных и международных финансовых рынков   | национальных и международных финансовых систем и финансовых рынков   | проводить анализ различных рисков в зависимости от целей и в разрезе отдельных видов риска на основе установленных методических принципов и подходов;<br>осуществлять количественную и качественную оценку уровня (пороговых значений, условных зон) рисков в разрезе отдельных видов деятельности хозяйствующих субъектов, направлений функционирования звеньев финансовой системы и сегментов финансового рынка;<br>разрабатывать отдельные функциональные направления управления рисками; отбирать подходящие методы воздействия на отдельные виды рисков и эффективно применять их с учетом их результативности и экономической эффективности;<br>осуществлять расчеты, прогнозировать, тестировать и верифицировать методики управления рисками с учетом отраслевой специфики  |                |
| 50 – 69 баллов | «зачтено» | ПК-1 Способен осуществлять мониторинг конъюнктуры рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, иностранной валюты, товарно-сырьевых рынков | ПК-1.1. Проводит исследование финансового рынка и изучает предложения финансовых услуг (в том числе действующих правил и условий, тарифной политики и действующих форм документации) | <b>Знает на базовом уровне, с ошибками:</b><br>конъюнктуру и механизмы функционирования финансовых рынков; основы формирования и структуру современной финансовой системы, историю ее развития; подходы к определению структуры финансового рынка и оценки его конъюнктуры;<br>характеристики финансовых продуктов и услуг, в т.ч. базовые банковские, страховые и инвестиционные продукты и услуги;<br>систему розничных финансовых услуг, применяемых при управлении личными финансами домохозяйств (инвестиционные, кредитные, страховые, пенсионные), их качественные, количественные характеристики;<br>основные мировые и российские тенденции изменения законодательства, регулирующего финансовую деятельность<br><b>Умеет на базовом уровне, с ошибками:</b><br>анализировать особенности современной государственной финансовой политики Российской Федерации, анализировать актуальные проблемы и направления развития российской и мировой финансовой системы;<br>давать оценку составу, структуре и эффективности использования инструментов финансового рынка, производить информационно-аналитическую работу по рынку финансовых продуктов и услуг;<br>мыслить системно, структурировать информацию для принятия управленческих решений в сфере финансов | <b>Базовый</b> |
|                |           | ПК-4. Способен выявлять, анализировать и оценивать экономические и  | ПК-4.1. Анализирует и оценивает различные виды финансовых рисков в разрезе отдельных видов деятельности  | <b>Знает на базовом уровне, с ошибками:</b><br>источники получения данных о состоянии финансовой системы, сегментов финансового рынка для выявления, анализа и оценки потенциальных финансовых рисков экономических агентов;  |                |

|                 |              |   |  |  |                             |
|-----------------|--------------|---|--|--|-----------------------------|
|                 |              | финансовые риски компаний, органов власти, населения, риски функционирования национальных и международных финансовых рынков               | субъектов макро- и микро-уровней, рисков функционирования национальных и международных финансовых систем и финансовых рынков   | методы анализа и оценки рисков с позиции их идентификации по функциональным областям<br><b>Умеет на базовом уровне, с ошибками:</b><br>проводить анализ различных рисков в зависимости от целей и в разрезе отдельных видов риска на основе установленных методических принципов и подходов;<br>осуществлять количественную и качественную оценку уровня (пороговых значений, условных зон) рисков в разрезе отдельных видов деятельности хозяйствующих субъектов, направлений функционирования звеньев финансовой системы и сегментов финансового рынка;<br>разрабатывать отдельные функциональные направления управления рисками; отбирать подходящие методы воздействия на отдельные виды рисков и эффективно применять их с учетом их результативности и экономической эффективности;<br>осуществлять расчеты, прогнозировать, тестировать и верифицировать методики управления рисками с учетом отраслевой специфики  |                             |
| менее 50 баллов | «не зачтено» | ПК-1 Способен осуществлять мониторинг конъюнктуры рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, иностранной валюты, товарно-сырьевых рынков | ПК-1.1. Проводит исследование финансового рынка и изучает предложения финансовых услуг (в том числе действующих правил и условий, тарифной политики и действующих форм документации) | <b>Не знает на базовом уровне:</b><br>конъюнктуру и механизмы функционирования финансовых рынков;<br>основы формирования и структуру современной финансовой системы, историю ее развития; подходы к определению структуры финансового рынка и оценки его конъюнктуры;<br>характеристики финансовых продуктов и услуг, в т.ч. базовые банковские, страховые и инвестиционные продукты и услуги;<br>систему розничных финансовых услуг, применяемых при управлении личными финансами домохозяйств (инвестиционные, кредитные, страховые, пенсионные), их качественные, количественные характеристики;<br>основные мировые и российские тенденции изменения законодательства, регулирующего финансовую деятельность<br><b>Не умеет на базовом уровне:</b><br>анализировать особенности современной государственной финансовой политики Российской Федерации, анализировать актуальные проблемы и направления развития российской и мировой финансовой системы;<br>давать оценку составу, структуре и эффективности использования инструментов финансового рынка, производить информационно-аналитическую работу по рынку финансовых продуктов и услуг;<br>мыслить системно, структурировать информацию для принятия управленческих решений в сфере финансов | Компетенции не сформированы |

|  |  |   |   |   |  |
|--|--|---|---|---|--|
|  |  | <p>ПК-4. Способен выявлять, анализировать и оценивать экономические и финансовые риски компаний, органов власти, населения, риски функционирования национальных и международных финансовых рынков</p> | <p>ПК-4.1. Анализирует и оценивает различные виды финансовых рисков в разрезе отдельных видов деятельности субъектов макро- и микро-уровней, рисков функционирования национальных и международных финансовых систем и финансовых рынков</p> | <p><b>Не знает на базовом уровне:</b><br/> источники получения данных о состоянии финансовой системы, сегментов финансового рынка для выявления, анализа и оценки потенциальных финансовых рисков экономических агентов;<br/> методы анализа и оценки рисков с позиции их идентификации по функциональным областям</p> <p><b>Не умеет на базовом уровне:</b><br/> проводить анализ различных рисков в зависимости от целей и в разрезе отдельных видов риска на основе установленных методических принципов и подходов;<br/> осуществлять количественную и качественную оценку уровня (пороговых значений, условных зон) рисков в разрезе отдельных видов деятельности хозяйствующих субъектов, направлений функционирования звеньев финансовой системы и сегментов финансового рынка;<br/> разрабатывать отдельные функциональные направления управления рисками;<br/> отбирать подходящие методы воздействия на отдельные виды рисков и эффективно применять их с учетом их результативности и экономической эффективности;<br/> осуществлять расчеты, прогнозировать, тестировать и верифицировать методики управления рисками с учетом отраслевой специфики</p> |  |
|--|--|---|---|---|--|