

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»

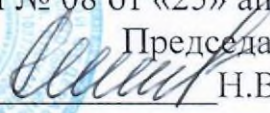
Министерство науки и высшего образования Российской Федерации
федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования

«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 **Международные финансы**

Направление подготовки	38.03.01 Экономика
Направленность (профиль) программы	Финансы и кредит
Уровень высшего образования	Бакалавриат

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 **Международные финансы**

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

Формируемые компетенции (код и наименование компетенции)	Индикаторы достижения компетенций (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. Проведение исследования финансового рынка и изучение предложений финансовых услуг (в том числе действующих правил и условий, тарифной политики и действующих форм документации)	ПК-1.1.3-1. Знает конъюнктуру и механизмы функционирования финансовых рынков ПК-1.1.3-2. Знает основы формирования и структуру современной финансовой системы, историю ее развития; подходы к определению структуры финансового рынка и оценки его конъюнктуры ПК-1.1.3-3. Знает характеристики финансовых продуктов и услуг, в т.ч. базовые банковские, страховые и инвестиционные продукты и услуги ПК-1.1.3-4. Знает систему розничных финансовых услуг, применяемых при управлении личными финансами домохозяйств (инвестиционные, кредитные, страховые, пенсионные), их качественные, количественные характеристики	Темы 1-6

		ПК-1.1.3-5. Знает основные мировые и российские тенденции изменения законодательства, регулирующего финансовую деятельность	
		ПК-1.1. У-1. Умеет анализировать особенности современной государственной финансовой политики Российской Федерации, анализировать актуальные проблемы и направления развития российской и мировой финансовой системы ПК-1.1.У-2 Умеет давать оценку составу, структуре и эффективности использования инструментов финансового рынка, производить информационно-аналитическую работу по рынку финансовых продуктов и услуг ПК-1.1.У-3. Умеет мыслить системно, структурировать информацию для принятия управленческих решений в сфере финансов.	Темы 1-6
ПК-4. Способен выявлять, анализировать и оценивать экономические и финансовые риски компаний, органов власти, населения, риски	ПК-4.1. Анализирует и оценивает различные виды финансовых рисков в разрезе отдельных видов деятельности субъектов макро- и	ПК-4.1.3-1. Знает источники получения данных о состоянии финансовой системы, сегментов финансового рынка для выявления, анализа и оценки потенциальных	Темы 1-6

<p>функционирования национальных и международных финансовых рынков</p>	<p>микроуровней, рисков функционирования национальных и международных финансовых систем и финансовых рынков</p>	<p>финансовых рисков экономических агентов. ПК-4.1.3-2. Знает методы анализа и оценки рисков с позиции их идентификации по функциональным областям</p>	
		<p>ПК-4.1.У-1. Умеет проводить анализ различных рисков в зависимости от целей и в разрезе отдельных видов риска на основе установленных методических принципов и подходов. ПК-4.1.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. ПК-4.1.У-3. Умеет разрабатывать отдельные функциональные направления управления рисками ПК-4.1.У-4. Умеет отбирать подходящие методы воздействия на отдельные виды рисков и эффективно применять их с учетом их результативности и экономической эффективности. ПК-4.1.У-5. Умеет осуществлять расчеты,</p>	

		прогнозировать, тестировать и верифицировать методики управления рисками с учетом отраслевой специфики	
--	--	---	--

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 экзаменационного билета

<i>Наименование</i>	<i>Максимальное количество баллов</i>
<i>Вопрос 1</i>	<i>10</i>
<i>Вопрос 2</i>	<i>15</i>
<i>Расчетно-аналитическое задание</i>	<i>15</i>

Задания, включаемые в экзаменационный билет

Типовой перечень вопросов к экзамену:

Вопросы 1 - теоретические вопросы

1. Суть и характерные черты международных финансов.
2. Международная валютная система: понятие, роль, этапы развития.
3. Понятие валюты и валютных ценностей.
4. Классификация валют по статусу в мировой валютной системе.
5. Международные торговые расчеты: суть, особенности, факторы и предпосылки.
6. Понятие внешнеторгового контракта и его формы.
7. Суть и схема расчетов по международному банковскому переводу.
8. Документация при документарных формах международных торговых расчетов.
9. Суть и виды инкассового вида международных расчетов.
10. Схема расчетов при документарной форме международного инкассо.
11. Виды и участники документарного инкассо.
12. Суть и виды аккредитивной формы международных расчетов.
13. Схема расчетов при документарной форме международного аккредитива.
14. Формы документарного аккредитива.
15. Функциональная роль участников документарного вида международного аккредитива.
16. Международные банковские корреспондентские отношения.
17. Методологические основы и роль платежного баланса в экономике.

Вопросы 2 - проблемно-аналитические вопросы

1. Сущность, принципы и особенности Европейской валютной системы.
2. Суть и характерные черты международного финансового рынка.
3. Мировые валюты: характеристики и условия формирования.
4. Особенности национальных валют.
5. Характеристика ведущих резервных валют мира.
6. Тенденции валютной диверсификации.
7. Сущность и формы конвертируемости национальной валюты.
8. Конвертируемость российского рубля.
9. Валютная политика РФ.
10. Валютно-финансовые условия внешнеэкономических сделок.
11. Особенности платежного баланса РФ.
12. Методы регулирования платежного баланса.
13. Роль МВФ в становлении рыночных отношений в РФ.
14. Система международных валютно-финансовых организаций.

15. Роль и основные направления развития институциональной структуры международного финансового рынка.
16. Россия в системе международных финансовых отношений.
17. Россия в системе региональных организаций.

Типовые расчетно-аналитические задания:

1. Предприятие покупает опцион «колл» на евро. Сумма опциона – 100 тыс. евро; цена страйк – 62,50 руб. за евро; премия опциона – 5000 рублей. Определить финансовый результат операции при текущем курсе на дату экспирации: а) 62,55 руб. за евро; б) 62,65 руб. за евро. При каких условиях на финансовых рынках целесообразно воспользоваться опционами? Связан ли статус национальной валюты с состоянием валютного рынка и структурой валютных операций?
2. Курс доллара расчетами "сегодня" на московском рынке составляет 60,00 руб. за доллар. Курс доллара расчетами "завтра" на рынке Новосибирска составляет 60,15 руб. Какую прибыль (в % от вложенного капитала) принесет арбитражная операция при отсутствии комиссионных платежей? При каких условиях на финансовых рынках целесообразно воспользоваться арбитражем? Связан ли статус национальной валюты с состоянием валютного рынка и структурой валютных операций?
3. Российская компания заключила контракт на экспорт своей продукции по цене 300 долл. за единицу. На российском рынке аналогичная продукция реализуется по цене 9000 руб. за единицу. По оценкам экспертов на момент оплаты продукции курс доллара будет составлять от 79,65 до 81,05 руб. за доллар (любые значения в этом интервале равновероятны). Какова вероятность того, что компания понесет курсовые убытки? При каком статусе национальной валюты наиболее вероятно выполнение условий данного задания?
4. Российская организация ожидает поступления средств от иностранного контрагента в сумме 450 тыс. евро. Срок платежа - 1 месяц. В настоящее время курс евро составляет 90,00 руб. за евро. Организация ожидает снижения курса евро к концу месяца до 89,50 руб. Контрагент согласен осуществить платеж немедленно при условии предоставления 2% скидки на сумму контракту. Следует ли компании соглашаться на эти условия? Ставку дисконтирования считать равной 15% годовых. Каким образом на валютно-финансовых условиях внешнеторгового контракта влияет статус национальной валюты стран контрагентов?
5. Предприятие покупает опцион «пут» на евро. Сумма опциона – 50 тыс. евро; цена страйк – 65,50 руб. за евро; премия опциона – 15000 рублей. Определить финансовый результат операции при текущем курсе на дату экспирации: а) 65,40 руб. за евро; б) 65,00 руб. за евро. В каких случаях для расчетов по внешнеторговому контракту целесообразно воспользоваться опционными операциями для приобретения валюты? Кому из контрагентов выгоднее использовать опцион при данной динамике валютного курса?
6. Курс доллара расчетами «сегодня» на московском рынке составляет 65,00 руб. за доллар. Курс доллара расчетами «завтра» на рынке Владивостока составляет 65,10 руб. Какую прибыль (в % от вложенного капитала) принесет арбитражная операция при отсутствии комиссионных платежей? В каких случаях участники внешнеторговой деятельности используют арбитраж?
7. Компания по условиям заключенных контрактов должна получить платеж в сумме 400 тыс. долл. от заказчика 1 января и перечислить 390 тыс. долл. поставщику 1 марта. Договор с заказчиком предусматривает штраф за задержку платежа, составляющий 0,001% в день, а с поставщиком - 0,02% в день. В январе-феврале компания планировала разместить временно свободные средства на депозит под 8% годовых. Однако из-за финансовых затруднений, заказчик осуществил оплату (включая штрафные санкции) только 15 апреля. Какие убытки понесла компания из-за задержки платежа?
8. Российская организация должна уплатить зарубежному поставщику 800 000 долл. США в течение месяца. Текущий курс доллара - 60,00 руб. за доллар. Организация ожидает роста курса в течение периода до 63,50. Рассматриваются два варианта действий: а) немедленная оплата по

текущему курсу; б) оплата в конце месяца по рыночному курсу на конец периода. Какой из этих вариантов предпочтительней? Ставку дисконтирования считать равной 20%.

9. Предприятие покупает опцион «пут» на евро. Сумма опциона – 150 тыс. евро; цена страйк – 73,00 руб. за евро; премия опциона – 45000 рублей. Определить финансовый результат операции при текущем курсе на дату экспирации: а) 72,85 руб. за евро; б) 72,40 руб. за евро.

10. Курс доллара расчетами "сегодня" на московском рынке составляет 71,25 руб. за доллар. Курс доллара расчетами "завтра" на рынке Владивостока составляет 75,00 руб. Какую прибыль (в % от вложенного капитала) принесет арбитражная операция при отсутствии комиссионных платежей? Как данная динамика валютного курса повлияет на состояние платежного баланса? Каковы меры урегулирования платежного баланса?

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

Шкала оценивания		Формируемые компетенции	Индикатор достижения компетенции	Критерии оценивания	Уровень освоения компетенций
85 – 100 баллов	«отлично»	ПК-1 ПК-4	ПК-1.1 ПК-4.1	Знает верно и в полном объеме: 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, характеристики финансовых продуктов и услуг, в т.ч. базовые банковские, страховые и инвестиционные продукты и услуги, систему розничных финансовых услуг, применяемых при управлении личными финансами домохозяйств (инвестиционные, кредитные, страховые, пенсионные), их качественные, количественные характеристики, основные мировые и российские тенденции изменения законодательства, регулирующего финансовую деятельность, источники получения данных о состоянии финансовой системы, сегментов финансового рынка для	Продвинутый

			<p>выявления, анализа и оценки потенциальных финансовых рисков экономических агентов, методы анализа и оценки рисков с позиции их идентификации по функциональным областям</p> <p>Умеет верно и в полном объеме:</p> <p>анализировать особенности современной государственной финансовой политики Российской Федерации, анализировать актуальные проблемы и направления развития российской и мировой финансовой системы, давать оценку составу, структуре и эффективности использования инструментов финансового рынка, производить информационно-аналитическую работу по рынку финансовых продуктов и услуг, мыслить системно, структурировать информацию для принятия управленческих решений в сфере финансов, проводить анализ различных рисков в зависимости от целей и в разрезе отдельных видов риска на основе установленных методических принципов и подходов, 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>
--	--	--	--

				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, осуществлять расчеты, прогнозировать, тестировать и верифицировать методики управления рисками с учетом отраслевой специфики.	
70 – 84 баллов	«хорошо»	ПК-1 ПК-4	ПК-1.1 ПК-4.1	<p>Знает с незначительными замечаниями:</p> <p>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, характеристики финансовых продуктов и услуг, в т.ч. базовые банковские, страховые и инвестиционные продукты и услуги, систему розничных финансовых услуг, применяемых при управлении личными финансами домохозяйств (инвестиционные, кредитные, страховые, пенсионные), их качественные, количественные характеристики, основные мировые и российские тенденции изменения законодательства, регулирующего финансовую деятельность, источники получения данных о состоянии финансовой системы, сегментов финансового рынка для</p>	Повышенный

			<p>выявления, анализа и оценки потенциальных финансовых рисков экономических агентов, методы анализа и оценки рисков с позиции их идентификации по функциональным областям.</p> <p>Умеет с незначительными замечаниями:</p> <p>анализировать особенности современной государственной финансовой политики Российской Федерации, анализировать актуальные проблемы и направления развития российской и мировой финансовой системы, давать оценку составу, структуре и эффективности использования инструментов финансового рынка, производить информационно-аналитическую работу по рынку финансовых продуктов и услуг, мыслить системно, структурировать информацию для принятия управленческих решений в сфере финансов, проводить анализ различных рисков в зависимости от целей и в разрезе отдельных видов риска на основе установленных методических принципов и подходов, 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>	
--	--	--	---	--

				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, осуществлять расчеты, прогнозировать, тестировать и верифицировать методики управления рисками с учетом отраслевой специфики.	
50 – 69 баллов	«удовлетворительно»	ПК-1 ПК-4	ПК-1.1 ПК-4.1	<p>Знает на базовом уровне, с ошибками:</p> <p>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, характеристики финансовых продуктов и услуг, в т.ч. базовые банковские, страховые и инвестиционные продукты и услуги, систему розничных финансовых услуг, применяемых при управлении личными финансами домохозяйств (инвестиционные, кредитные, страховые, пенсионные), их качественные, количественные характеристики, основные мировые и российские тенденции изменения законодательства, регулирующего финансовую деятельность, источники получения данных о состоянии финансовой системы, сегментов финансового рынка для</p>	Базовый

			<p>выявления, анализа и оценки потенциальных финансовых рисков экономических агентов, методы анализа и оценки рисков с позиции их идентификации по функциональным областям.</p> <p>Умеет на базовом уровне, с ошибками: анализировать особенности современной государственной финансовой политики Российской Федерации, анализировать актуальные проблемы и направления развития российской и мировой финансовой системы, давать оценку составу, структуре и эффективности использования инструментов финансового рынка, производить информационно-аналитическую работу по рынку финансовых продуктов и услуг, мыслить системно, структурировать информацию для принятия управленческих решений в сфере финансов, проводить анализ различных рисков в зависимости от целей и в разрезе отдельных видов риска на основе установленных методических принципов и подходов, 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>	
--	--	--	--	--

				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, осуществлять расчеты, прогнозировать, тестировать и верифицировать методики управления рисками с учетом отраслевой специфики.	
менее 50 баллов	«неудовлетворительно»	ПК-1 ПК-4	ПК-1.1 ПК-4.1	<p>Не знает на базовом уровне: 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, характеристики финансовых продуктов и услуг, в т.ч. базовые банковские, страховые и инвестиционные продукты и услуги, систему розничных финансовых услуг, применяемых при управлении личными финансами домохозяйств (инвестиционные, кредитные, страховые, пенсионные), их качественные, количественные характеристики, основные мировые и российские тенденции изменения законодательства, регулирующего финансовую деятельность, источники получения данных о состоянии финансовой системы, сегментов финансового рынка для выявления, анализа и</p>	Компетенции не сформированы

			<p>оценки потенциальных финансовых рисков экономических агентов, методы анализа и оценки рисков с позиции их идентификации по функциональным областям.</p> <p>Не умеет на базовом уровне: анализировать особенности современной государственной финансовой политики Российской Федерации, анализировать актуальные проблемы и направления развития российской и мировой финансовой системы, давать оценку составу, структуре и эффективности использования инструментов финансового рынка, производить информационно-аналитическую работу по рынку финансовых продуктов и услуг, мыслить системно, структурировать информацию для принятия управленческих решений в сфере финансов, проводить анализ различных рисков в зависимости от целей и в разрезе отдельных видов риска на основе установленных методических принципов и подходов, 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, разрабатывать отдельные функциональные</p>	
--	--	--	---	--

				направления управления рисками, отбирать подходящие методы воздействия на отдельные виды рисков и эффективно применять их с учетом их результативности и экономической эффективности, осуществлять расчеты, прогнозировать, тестировать и верифицировать методики управления рисками с учетом отраслевой специфики.	
--	--	--	--	---	--