

Документ подписан электронной подписью

Информация о владельце:

ФИО: Ашмарина Светлана Игоревна

Должность: Ректор ФГБОУ ВО «Самарский государственный экономический университет»

Дата подписания: 01.02.2020

Уникальный программный ключ:

59650034d6e3a6baac49b7bd0f8e79fea1433ff3e82f1fc7e9279a031181baba

**Министерство науки и высшего образования Российской Федерации
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Самарский государственный экономический университет»**

Институт национальной и мировой экономики
Кафедра Статистики и эконометрики

УТВЕРЖДЕНО
Ученым советом Университета
(протокол № 10 от 29 апреля 2020 г.)

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

Наименование дисциплины Б1.В.ДВ.08.02 Статистика финансово-
коммерческих расчетов и валютных операций

Основная профессиональная образовательная программа Направление 38.03.01 Экономика программа
"Бизнес-аналитика и статистика"

Методический отдел УМУ
« 14 » 04 20 20 г.
[Подпись]

Научная библиотека СГЭУ
« 14 » 04 20 20 г.
[Подпись]

Рассмотрено к утверждению
на заседании кафедры Статистики и эконометрики
(протокол № 10 от 25.03.2020г.)
Зав. кафедрой *[Подпись]* / О.В. Баканач /

Квалификация (степень) выпускника бакалавр

Содержание (рабочая программа)

Стр.

- 1 Место дисциплины в структуре ОП
- 2 Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе
- 3 Объем и виды учебной работы
- 4 Содержание дисциплины
- 5 Материально-техническое и учебно-методическое обеспечение дисциплины
- 6 Фонд оценочных средств по дисциплине

Целью изучения дисциплины является формирование результатов обучения, обеспечивающих достижение планируемых результатов освоения образовательной программы.

1. Место дисциплины в структуре ОП

Дисциплина Статистика финансово-коммерческих расчетов и валютных операций входит в вариативную часть (дисциплина по выбору) блока Б1. Дисциплины (модули)

Предшествующие дисциплины по связям компетенций: Микроэкономическая статистика, Финансы

Последующие дисциплины по связям компетенций: Финансовая статистика, Практикум по рынку ценных бумаг, Технический анализ рынка ценных бумаг

2. Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе

Изучение дисциплины Статистика финансово-коммерческих расчетов и валютных операций в образовательной программе направлено на формирование у обучающихся следующих компетенций:

Профессиональные компетенции (ПК):

ПК-5 - способностью анализировать и интерпретировать финансовую, бухгалтерскую и иную информацию, содержащуюся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д. и использовать полученные сведения для принятия управленческих решений

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
ПК-5	Знать	Уметь	Владеть (иметь навыки)
	ПК5з1: методы анализа и интерпретации финансовой, бухгалтерской и иной информации, содержащейся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д.	ПК5у1: анализировать и интерпретировать финансовую, бухгалтерскую и иную информацию, содержащуюся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д.	ПК5в1: навыками анализа, интерпретации экономических показателей содержащихся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д.
	ПК5з2: способы применения результатов анализа и интерпретации финансовой, бухгалтерской и иной информации, содержащейся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д., для принятия управленческих решений	ПК5у2: использовать полученные в результате анализа бухгалтерской и иной информации, содержащейся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д. для принятия управленческих решений	ПК5в2: методами принятия управленческих решений по итогам результатов анализа и интерпретации финансовой, бухгалтерской и иной информации, содержащейся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д.

3. Объем и виды учебной работы

Учебным планом предусматриваются следующие виды учебной работы по дисциплине:

Очная форма обучения

Виды учебной работы	Всего час/ з.е.
	Сем 7
Контактная работа, в том числе:	56.4/1.57
Занятия лекционного типа	18/0.5
Занятия семинарского типа	36/1
Индивидуальная контактная работа (ИКР)	0.4/0.01
Групповая контактная работа (ГКР)	2/0.06
Самостоятельная работа, в том числе:	43.6/1.21
Промежуточная аттестация	8/0.22
Вид промежуточной аттестации: Экзамен	Экз
Общая трудоемкость (объем части образовательной программы): Часы Зачетные единицы	108 3

4. Содержание дисциплины

4.1. Разделы, темы дисциплины и виды занятий:

Тематический план дисциплины Статистика финансово-коммерческих расчетов и валютных операций представлен в таблице.

Разделы, темы дисциплины и виды занятий Очная форма обучения

№ п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Контактная работа				Самостоятельная работа	Планируемые результаты обучения в соотношении с результатами обучения по образовательной программе
		Лекции	Занятия семинарского типа Практич. занятия	ИКР	ГКР		
1.	Статистика валютных операций	8	18			20	ПК5з1, ПК5з2, ПК5у1, ПК5у2, ПК5в1, ПК5в2
2.	Финансово-коммерческие расчеты и статистика производных ценных бумаг	10	18			23,6	ПК5з1, ПК5з2, ПК5у1, ПК5у2, ПК5в1, ПК5в2
	Контроль	8					
	Итого	18	36	0.4	2	43.6	

4.2 Содержание разделов и тем

4.2.1 Контактная работа

Тематика занятий лекционного типа

№п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Вид занятия лекционного типа*	Тематика занятия лекционного типа
------	--	-------------------------------	-----------------------------------

1.	Статистика валютных операций	лекция	Предмет и задачи статистики финансово-коммерческих расчетов и валютных операций
		лекция	Статистика валютного рынка
		лекция	Статистика валютных курсов
		лекция	Статистика валютных операций
2.	Финансово-коммерческие расчеты и статистика производных ценных бумаг	лекция	Биржевая статистика производных ценных бумаг
		лекция	Основы теории финансово-коммерческих расчетов операций с производными финансовыми инструментами
		лекция	Финансово-коммерческие расчеты форвардных и фьючерсных операций
		лекция	Финансово-коммерческие расчеты опционных операций, валютных и процентных свопов

*лекции и иные учебные занятия, предусматривающие преимущественную передачу учебной информации педагогическими работниками организации и (или) лицами, привлекаемыми организацией к реализации образовательных программ на иных условиях, обучающимся

Тематика занятий семинарского типа

№п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Вид занятия семинарского типа**	Тематика занятия семинарского типа
1.	Статистика валютных операций	практическое занятие	Предмет и задачи статистики финансово-коммерческих расчетов и валютных операций
		практическое занятие	Статистика валютного рынка
		практическое занятие	Статистика валютных курсов
		практическое занятие	Статистика валютных операций
2.	Финансово-коммерческие расчеты и статистика производных ценных бумаг	практическое занятие	Биржевая статистика производных ценных бумаг
		практическое занятие	Основы теории финансово-коммерческих расчетов операций с производными финансовыми инструментами
		практическое занятие	Финансово-коммерческие расчеты форвардных и фьючерсных операций
		практическое занятие	Финансово-коммерческие расчеты опционных операций, валютных и процентных свопов

** семинары, практические занятия, практикумы, лабораторные работы, коллоквиумы и иные аналогичные занятия

Иная контактная работа

При проведении учебных занятий СГЭУ обеспечивает развитие у обучающихся навыков командной работы, межличностной коммуникации, принятия решений, лидерских качеств (включая при необходимости проведение интерактивных лекций, групповых дискуссий, ролевых игр, тренингов, анализ ситуаций и имитационных моделей, преподавание дисциплин (модулей) в

форме курсов, составленных на основе результатов научных исследований, проводимых организацией, в том числе с учетом региональных особенностей профессиональной деятельности выпускников и потребностей работодателей).

Формы и методы проведения иной контактной работы приведены в Методических указаниях по основной профессиональной образовательной программе.

4.2.2 Самостоятельная работа

№п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Вид самостоятельной работы ***
1.	Статистика валютных операций	- подготовка доклада - подготовка электронной презентации -выполнение домашних заданий
		- тестирование
2.	Финансово-коммерческие расчеты и статистика производных ценных бумаг	- подготовка доклада - подготовка электронной презентации -выполнение домашних заданий - тестирование

*** самостоятельная работа в семестре, написание курсовых работ, докладов, выполнение контрольных работ

5. Материально-техническое и учебно-методическое обеспечение дисциплины

5.1 Литература:

Основная литература

1. Статистика : учебник для прикладного бакалавриата / под редакцией И. И. Елисеевой. — 3-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2019. — 361 с. — (Бакалавр. Прикладной курс). — ISBN 978-5-534-04082-1. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://www.biblio-online.ru/bcode/431720>
2. Малых, Н. И. Статистика в 2 т. Том 1 теория статистики : учебник и практикум для академического бакалавриата / Н. И. Малых. — Москва : Издательство Юрайт, 2019. — 275 с. — (Серия : Бакалавр. Академический курс). — ISBN 978-5-534-03894-1. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://biblio-online.ru/bcode/432972>
3. Малых, Н. И. Статистика в 2 т. Том 2 социально-экономическая статистика : учебник и практикум для академического бакалавриата / Н. И. Малых. — Москва : Издательство Юрайт, 2019. — 473 с. — (Серия : Бакалавр. Академический курс). — ISBN 978-5-534-03185-0. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://biblio-online.ru/bcode/433498>

Дополнительная литература

1. Статистика. Практикум : учебное пособие для академического бакалавриата / И. И. Елисеева [и др.] ; под редакцией И. И. Елисеевой. — Москва : Издательство Юрайт, 2019. — 514 с. — (Бакалавр. Академический курс). — ISBN 978-5-9916-3688-9. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://www.biblio-online.ru/bcode/425262>
2. Долгова, В. Н. Социально-экономическая статистика : учебник и практикум для академического бакалавриата / В. Н. Долгова, Т. Ю. Медведева. — Москва : Издательство Юрайт, 2019. — 269 с. — (Серия : Бакалавр. Академический курс). — ISBN 978-5-534-01414-3. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://biblio-online.ru/bcode/433621>

3. Чистик О. Ф. Статистика. Общая теория статистики [Электронный ресурс] : практикум. - Самара : Изд-во Самар. гос. экон. ун-та, 2017. - 60 с. - ISBN 978-5-94622-678-3. <http://lib1.sseu.ru/MegaPro/Web>
4. Статистика. Социально-экономическая статистика [Электронный ресурс] : учеб. пособие для вузов / науч. ред. О. Ф.Чистик . - УМО, 6-е изд., испр. и доп. - Самара : Изд-во Самар. гос. экон. ун-та, 2012. - 280 с. - ISBN 978-5-94622-364-5. <http://lib1.sseu.ru/MegaPro/Web>

Литература для самостоятельного изучения

1. Беннинг Шимон. Финансовое моделирование с использованием Excel / Financial Modeling — Изд-во: Вильямс. 2007г. - 592с.
2. Блинова С.В. Теория статистики: практикум по статистическим методам с использованием пакета Excel.- Самара: Изд-во Самар. гос. экон. ун-та, 2010.
3. Гуськова Т.Н., Рябцев В.М., Гениатулин В.Н. Оценка инвестиционной привлекательности объектов статистическими методами. М.: ГАСБУ, 1999. 150 с.
4. Дуброва, Т.А. Статистические методы прогнозирования в экономике: Учебное пособие. – М.: ЕАОИ, 2011. – 171 с. – Электронное издание. — УМО. — ISBN 978-5-374-00122-8 <http://ibooks.ru/product.php?productid=334365>
5. Методы финансовых и коммерческих расчетов. [Электронный ресурс]: учебное пособие / Новикова В.Н., Ратафьев С.В., Смирнов Н.А. – Электрон.дан. – Н.Новгород.: Нижегород. гос. техн. ун-т, 2016
6. Практикум по статистике финансов. / Назаров М.Г – М. КноРус, 2009. – 304с.
7. Статистика для бакалавров с основами бизнес-статистики: учебник / отв.ред. Е.В. Зарова, Москва: ФГБОУ ВПО «РЭУ им. Г.В. Плеханова», 2014. – 440 с.
8. Статистика финансов: Учеб. / Под ред. В.Н. Салина. М.: Финансы и статистика, 2000. 816 с.
9. Статистика финансов: учебник / под.ред. Назарова М.Г. - МО, 4-е изд. - М. : ОМЕГА-Л, 2008. - (Высшее экономическое образование).
10. Финансовые инвестиции: учебник /В.Е. Барбаумов, И. М. Гладких, А.С. Чуйко. – М.: "Финансы и статистика", 2006. – 544 с.
11. Четыркин Е.М. Методы финансовых и коммерческих расчетов. – 4-е изд., испр. и доп. - М.: «Дело Лтд», 2004. – 400с.

Периодические издания:

1. Журнал «Вопросы статистики» - <http://www.statbook.ru/ru/vopr/vopr.htm>
2. Журнал «Вопросы экономики» - <http://www.vopreco.ru/index.html>
3. Российский статистический ежегодник - <http://www.gks.ru>

5.2. Перечень лицензионного программного обеспечения

1. Microsoft Windows 10 Education / Microsoft Windows 7 / Windows Vista Business
2. Office 365 ProPlus, Microsoft Office 2019, Microsoft Office 2016 Professional Plus (Word, Excel, Access, PowerPoint, Outlook, OneNote, Publisher) / Microsoft Office 2007 (Word, Excel, Access, PowerPoint)
3. STATISTICA 6.0 (инд. польз.)
4. STATISTICA Ultimate Academic Bundle 10 for Windows ru
5. Statistica Ultimate Academic 13 for Windows Ru сетевая версия на 25 пользователей

5.3 Современные профессиональные базы данных, к которым обеспечивается доступ обучающихся

1. Профессиональная база данных «Информационные системы Министерства экономического развития Российской Федерации в сети Интернет» (Портал «Официальная Россия» - <http://www.gov.ru/>)
2. Профессиональная база данных «Финансово-экономические показатели Российской Федерации» (Официальный сайт Министерства финансов РФ - <https://www.minfin.ru/ru/>)
3. Профессиональная база данных «Официальная статистика» (Официальный сайт Федеральной службы государственной статистики - <http://www.gks.ru/>)

5.4. Информационно-справочные системы, к которым обеспечивается доступ обучающихся

1. справочно-правовая система «Консультант Плюс»
2. справочно-правовая система «ГАРАНТ-Максимум»

5.5. Специальные помещения

Учебные аудитории для проведения занятий лекционного типа	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран
Учебные аудитории для проведения практических занятий (занятий семинарского типа)	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Учебные аудитории для групповых и индивидуальных консультаций	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Учебные аудитории для текущего контроля и промежуточной аттестации	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Помещения для самостоятельной работы	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Помещения для хранения и профилактического обслуживания оборудования	Комплекты специализированной мебели для хранения оборудования

Для проведения занятий лекционного типа используются демонстрационное оборудование и учебно-наглядные пособия в виде презентационных материалов, обеспечивающих тематические иллюстрации.

5.6 Лаборатории и лабораторное оборудование

Лаборатория информационных технологий в профессиональной деятельности	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ Лабораторное оборудование
---	--

6. Фонд оценочных средств по дисциплине Статистика финансово-коммерческих расчетов и валютных операций:

6.1. Контрольные мероприятия по дисциплине

Вид контроля	Форма контроля	Отметить нужное знаком «+»
Текущий контроль	Оценка докладов	+
	Устный опрос	+
	Тестирование	+
	Практические задачи	-
Промежуточный контроль	Экзамен	+

Порядок проведения мероприятий текущего и промежуточного контроля определяется Методическими указаниями по основной профессиональной образовательной программе высшего образования, утвержденными Ученым советом ФГБОУ ВО СГЭУ №10 от 29.04.2020г.

6.2. Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе Профессиональные компетенции (ПК):

ПК-5 - способностью анализировать и интерпретировать финансовую, бухгалтерскую и иную информацию, содержащуюся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д. и использовать полученные сведения для принятия управленческих решений

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
	Знать	Уметь	Владеть (иметь навыки)

Пороговый	ПК5з1: методы анализа и интерпретации финансовой, бухгалтерской и иной информации, содержащейся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д.	ПК5у1: анализировать и интерпретировать финансовую, бухгалтерскую и иную информацию, содержащуюся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д.	ПК5в1: навыками анализа, интерпретации экономических показателей содержащихся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д.
Повышенный	ПК5з2: способы применения результатов анализа и интерпретации финансовой, бухгалтерской и иной информации, содержащейся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д., для принятия управленческих решений	ПК5у2: использовать полученные в результате анализа бухгалтерской и иной информации, содержащейся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д. для принятия управленческих решений	ПК5в2: методами принятия управленческих решений по итогам результатов анализа и интерпретации финансовой, бухгалтерской и иной информации, содержащейся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д.

6.3. Паспорт оценочных материалов

№ п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Контролируемые планируемые результаты обучения в соотношении с результатами обучения по программе	Вид контроля/используемые оценочные средства	
			Текущий	Промежуточный
1.	Статистика валютных операций	ПК5з1, ПК5з2, ПК5у1, ПК5у2, ПК5в1, ПК5в2	Оценка докладов Устный опрос Тестирование	Экзамен
2.	Финансово-коммерческие расчеты и статистика производных ценных бумаг	ПК5з1, ПК5з2, ПК5у1, ПК5у2, ПК5в1, ПК5в2	Оценка докладов	Экзамен

обработки информации по финансовым опе

Раздел дисциплины	Темы
Статистика валютных операций	<ol style="list-style-type: none"> 1. Статистические методы изучения деятельности учреждений и организаций финансово-кредитной инфраструктуры, денежно-валютного и фондового рынка. 2. Вопросы компьютеризации финансово-коммерческих расчетов и статистической

			Устный опрос Тестирование	
--	--	--	---------------------------------	--

6.4. Оценочные материалы для текущего контроля

Примерная тематика докладов

	<p>ческая характеристика основных её звеньев. Виды валютных рынков.</p> <ol style="list-style-type: none"> 6. Статистический анализ операций по купле - продаже валюты на валютной бирже. 7. Статистическая характеристика международного фондового рынка. 8. Статистические методы моделирования и прогнозирования операций валютного рынка. 9. Основные виды биржевых графиков валютных курсов, правила их построения и анализа. 10. Построение и анализ осцилляторов валютных курсов. 11. Статистические методы моделирования и прогнозирования валютных курсов. 12. Методология финансово-экономических расчетов и их использование в статистическом анализе операций валютного рынка. 13. Статистические показатели, характеризующие валютные операции с использованием банковских карт. 14. Статистические методы оценки валютных рисков и бизнес-рисков. Инструменты статистического расчета валютных рисков. 15. Страхование портфелей акций с помощью опционов на индексы акций. Биноминальная модель эволюции процентной ставки. 16. Методологические положения по хеджированию валютных рисков. Статистические методы оценки валютных рисков.
--	---

<p>Финансово-коммерческие расчеты и статистика производных ценных бумаг</p>	<p>17. Понятие производной ценной бумаги и задачи биржевой статистики. Информационное обеспечение статистической характеристики рынка производных финансовых инструментов.</p> <p>18. Статистическое изучение использования производных ценных бумаг и финансовых инструментов на валютном и денежном рынке</p> <p>19. Основные показатели деятельности опционных и фьючерсных бирж.</p> <p>20. Основные направления статистического изучения форвардных, фьючерсных и опционных биржевых сделок.</p> <p>21. Статистическое изучение форвардных, фьючерсных и опционных сделок.</p> <p>22. Понятие производного финансового инструмента. Задачи статистического изучения операций с производными финансовыми инструментами.</p> <p>23. Роль статистических методов анализа, моделирования и оценки производных финансовых инструментов в обеспечении эффективности и оптимизации управленческих решений по финансовым инвестициям.</p> <p>24. Статическая и динамическая оценка стоимости финансового инструмента.</p>
	<p>25. Структурные модели эволюции процентных ставок.</p> <p>26. Показатели прогнозируемых значений ставок и курсов валют.</p> <p>27. Статистический анализ процентного риска, моделирование денежных потоков и оценка рыночной стоимости производных финансовых инструментов срочного рынка.</p> <p>28. Источники статистической и аналитической информации для оценки форвардных и фьючерсных операций и расчета их доходности.</p> <p>29. Статистические методы оценки «теоретической» стоимости опционов. Модели оценки стоимости опциона.</p> <p>30. Базовые модели ценообразования опционов: биномиальная модель, модель Блэка - Шоулза.</p>

Вопросы для устного опроса

Раздел дисциплины	Вопросы
Статистика валютных операций	1. Предмет статистики финансово-коммерческих расчетов и валютных операций.

	<ol style="list-style-type: none"> 2. Теоретические основы статистики финансово-коммерческих расчетов и валютных операций. 3. Система показателей статистики финансово-коммерческих расчетов и валютных операций. 4. Статистика валютного рынка. Основные статистические показатели, характеризующие состояние и развитие национального валютного рынка. 5. Статистический анализ операций по купле - продаже валюты на валютной бирже. 7. Статистическая характеристика мирового валютного рынка. Основные инструменты международных денежных рынков. 8. Валютный курс как элемент количественной теории денег и финансовой статистики. Анализ факторов, влияющих на уровень и изменчивость валютных курсов 9. Методы учета влияния инфляционного процесса на уровень и динамику валютного курса. 10. Методы анализа курса национальной валюты. 11. Методика установления официального курса иностранных валют. 12. Средние показатели валютных курсов. 13. Статистические методы анализа вариации и динамики валютных курсов. 14. Статистика валютных операций. 15. Методология финансово-экономических расчетов и их использование в статистическом анализе валютных операций. 16. Методы сравнительного анализа финансовых
	<p>условий коммерческих соглашений по валютным операциям.</p> <ol style="list-style-type: none"> 17. Статистический анализ валютно - обменных операций банков. 18. Форфейтинговые валютные операции, их сущность. 19. Расчет номинальной стоимости форфетируемых векселей и дисконта. 20. Расчет дохода форфейтинговой сделки.

<p>Финансово-коммерческие расчеты и статистика производных ценных бумаг</p>	<ol style="list-style-type: none"> 21. Биржевая статистика производных ценных бумаг. Основные показатели деятельности опционных и фьючерсных бирж. 22. Статистический анализ процентного риска. 23. Моделирование денежных потоков и оценка рыночной стоимости производных финансовых инструментов срочного рынка. 24. Понятие операций хеджирования, спекуляции и арбитража. Практические приложения финансово-коммерческих расчетов с инструментами денежного и валютного рынка. 25. Анализ доходности форвардных операций. Определение величины премии и скидки. 26. Статистические методы оценки финансовых рисков активов и инвестиций. Хеджирование как способ страхования от ценовых рисков. 27. Инструменты статистического метода расчета финансового риска. 28. Статистические методы оценки «теоретической» стоимости опционов. Модели оценки стоимости опциона. 29. Оценка стоимости опционов на фьючерсные контракты. 30. Оценка стоимости процентных свопов. Валютные свопы и их оценка. 31. Опционные риски и коэффициенты чувствительности опционов.
---	---

Задания для тестирования по дисциплине для оценки сформированности компетенций (min 20, max 50 + ссылку на ЭИОС с тестами)

Материалы для тестирования по дисциплине размещены в электронно-информационной образовательной среде СГЭУ по ссылке: <https://lms2.sseu.ru/course/index.php?categoryid=514>

Финансово-экономические расчеты (высшие финансовые вычисления, финансовая математика) рассматривают изменение стоимости денежных средств, произошедшие в первую очередь в результате ...

- девальвации
- деноминации
- инвестирования
- инфляции

Если в краткосрочных финансовых операциях, процентные ставки применяются к одной и той же первоначальной денежной сумме в течение всего периода начисления, то они называются___(ввести ответ)

Какая из доходностей определяется при выпуске облигаций:

- биржевая
- полная
- текущая
- купонная

Номинальная ставка процентов определяет....

- годовую базовую ставку по договору
- годовую базовую ставку по договору, исходя из которой определяется ставка за конкретный период и эффективная доходность
- эффективную доходность

К финансовым экономическим активам по концепции СНС относят: (несколько вариантов ответа)

- валюту
- депозиты
- монетарное золото
- специальные права заимствования
- патенты
- лицензии

Наращивание по правилу простого процента происходит по сравнению с наращиванием по правилу сложного процента...

- быстрее в рамках одного года, затем медленнее
- быстрее
- медленнее в рамках одного года, затем быстрее
- медленнее

Эквивалентные финансовые платежи – это платежи...

- равные по размеру
- рассчитанные исходя из одинаковой ставки доходности
- подлежащие к уплате на одну и ту же дату
- равные по размеру, если оценены на одну и ту же дату

Если в краткосрочных финансовых операциях, процентные ставки применяются к одной и той же первоначальной денежной сумме в течение всего периода начисления, то они называются _____ (ввести ответ)

Если денежная масса составила 400 млрд. рублей, а денежная база – 200 млрд. рублей, то денежный мультипликатор будет равен: (ввести ответ)

Признаком недооцененности рынка считается уровень коэффициента $P(E)$, где: P – цена одной акции, E – прибыль, приходящаяся на одну акцию: _____ (ввести ответ)

Процентное соотношение суммы выплаченного страхового возмещения и суммы собственных страховых платежей называется _____ (ввести ответ)

Процентный платеж при начислении простых процентов за апрель оказывается наименьшим, если начисляют _____ (ввести ответ)

Проценты, выплачиваемые в момент предоставления кредита _____ (ввести ответ)

Расчетный показатель, используемый при анализе рискованности вложений в ценные бумаги, - это _____ (ввести ответ)

Рентабельность активов рассчитывается как отношение чистой прибыли к _____ (ввести ответ)

Рентабельность основного капитала определяется отношением _____ к средней стоимости основного капитала (ввести ответ)

Имеются следующие данные о количестве денег в обращении за первый квартал, млрд. руб.: на 01.01 - 130; на 01.02 - 120; на 01.03 - 180; на 01.04 - 220. Среднемесячное наличие денег в обращении за первый квартал составило _____ млрд.руб: (вести ответ)

Имеются условные данные о количестве выпущенных денежных знаков по достоинству купюр: Достоинство купюр 10 – 50 - 100 – 500 - 1000 - 5000; Выпуск денег в обращение, тыс. 200 – 150 – 140 – 160 – 150 – 60; Величина средней купюры, выпущенной в обращение будет равна _____ (вести ответ)

На какой срок необходимо поместить денежную сумму под простую процентную ставку 28% годовых, чтобы она увеличилась в 1,5 раза.

- 1,5
- 1,786
- 2,0
- 2,53

Коммерческий банк приобрел на 200,0 млн. рублей государственные краткосрочные облигации (ГКО) со сроком погашения шесть месяцев. По истечению указанного срока банк рассчитывает получить 402,0 млн. рублей. Указать доходность ГКО.

- 150%
- 202%
- 210%
- 250%

Контракт предусматривает следующий порядок начисления процентов: первый год 16%. В каждом последующем полугодии ставка повышается на 1%. Определить множитель наращенная за 2,5 года.

- 1,2
- 1,43
- 1,7
- 2,5

6.5. Оценочные материалы для промежуточной аттестации

Фонд вопросов для проведения промежуточного контроля в форме экзамена

Раздел дисциплины	Вопросы
Статистика валютных операций	<ol style="list-style-type: none">1. Предмет и задачи статистики финансово- коммерческих расчетов и валютных операций.2. Система показателей статистики финансово- коммерческих расчетов и валютных операций.3. Статистическое изучение международных финансово-коммерческих и валютных операций.4. Роль статистических методов анализа, моделирования и прогнозирования финансо-

	<p>во-коммерческих и валютных операций в обеспечении эффективности и оптимизации управленческих решений.</p> <ol style="list-style-type: none"> 5. Статистический анализ операций по купле - продаже валюты на валютной бирже. 6. Статистическая характеристика международного фондового рынка. 7. Методы анализа курса национальной валюты. 8. Методика установления официального курса иностранных валют. 9. Статистические методы фундаментального анализа международных паритетных валютных отношений. 10. Статистические методы анализа вариации и динамики валютных курсов. 11. Основные виды биржевых графиков валютных курсов, правила их построения и анализа. 12. Статистические методы моделирования и прогнозирования валютных курсов. 13. Методология финансово-экономических расчетов и их использование в статистическом анализе валютных операций. 14. Статистика валютных операций. Виды валютных операций. 15. Механизм международных расчетов. 16. Определение дохода от валютных операций. 17. Статистические методы оценки валютных рисков и бизнес-рисков. 18. Инструменты статистического расчета валютных рисков.
<p>Финансово-коммерческие расчеты и статистика производных ценных бумаг</p>	<ol style="list-style-type: none"> 19. Статистический анализ процентного риска. 20. Моделирование денежных потоков и оценка рыночной стоимости производных финансовых инструментов срочного рынка. 21. Статистические методы оценки финансовых рисков активов и инвестиций. 22. Хеджирование как способ страхования от ценовых рисков. 23. Инструменты статистического метода расчета финансового риска. 24. Статистические методы оценки «теоретической» стоимости опционов. Модели оценки стоимости опциона. 25. Методологические положения по хеджированию валютных рисков. Статистические методы оценки валютных рисков. 26. Понятие своп - сделки и цели их осуществления. 27. Типы своп - операций. Котировки свопов. Спред свопа. 28. Оценка стоимости процентных свопов.

	<p>29. Валютные свопы и их оценка.</p> <p>30. Анализ доходности операций валютных и процентных свопов.</p>
--	--

6.6. Шкалы и критерии оценивания по формам текущего контроля и промежуточной аттестации

Шкала и критерии оценивания

Оценка	Критерии оценивания для мероприятий контроля с применением 4-х балльной системы
«отлично»	ПК5з1, ПК5з2, ПК5у1, ПК5у2, ПК5в1, ПК5в2
«хорошо»	ПК5з1, ПК5з2, ПК5у1, ПК5в1
«удовлетворительно»	ПК5з1, ПК5у1, ПК5в1
«неудовлетворительно»	Результаты обучения не сформированы на пороговом уровне