



# Управління валютними операціями (ПВЗ)

## Робоча програма навчальної дисципліни (Силабус)

### Реквізити навчальної дисципліни

Рівень вищої освіти	<i>Другий (магістерський)</i>
Галузь знань	<i>07 Управління та адміністрування</i>
Спеціальність	<i>073 Менеджмент</i>
Освітня програма	<i>Менеджмент міжнародного бізнесу</i>
Статус дисципліни	<i>Вибіркова</i>
Форма навчання	<i>очна(денна)</i>
Рік підготовки, семестр	<i>1 курс, весняний семестр</i>
Обсяг дисципліни	<i>4,5 кредити (135 годин)</i>
Семестровий контроль/ контрольні заходи	<i>Залік/тестування, модульна контрольна робота, розрахункова робота, семестрові атестації</i>
Розклад занять	
Мова викладання	<i>Українська</i>
Інформація про керівника курсу / викладачів	Лектор: к.е.н., доцент, Голюк Вікторія Яославівна, <a href="mailto:Goliuk_V@ukr.net">Goliuk_V@ukr.net</a> Практичні: к.е.н., доцент, Голюк Вікторія Яославівна, <a href="mailto:Goliuk_V@ukr.net">Goliuk_V@ukr.net</a>
Розміщення курсу	<a href="https://do.ipu.kpi.ua/course/view.php?id=3773">https://do.ipu.kpi.ua/course/view.php?id=3773</a>

### Програма навчальної дисципліни

#### 1. Опис навчальної дисципліни, її мета, предмет вивчення та результати навчання

Метою вивчення кредитного модуля «Управління валютними операціями» є формування у майбутніх фахівців з менеджменту таких компетентностей:

ФК 1 – Здатність обирати та використовувати концепції, методи та інструментарій менеджменту, в тому числі у відповідності до визначених цілей та міжнародних стандартів. Зокрема для налагодження співпраці з банками та іншими кредитно-фінансовими установами, у тому числі міжнародного масштабу,  
ФК 4 - Здатність до ефективного використання та розвитку ресурсів організації, зокрема у питаннях розробки стратегії хеджування валютних ризиків, реалізації валютних операцій, оформлення документації для реалізації валютних операцій.

Після засвоєння кредитного модуля студенти мають продемонструвати такі програмні результати навчання:

ПРН 14 Визначати і розробляти оптимальні форми організації зовнішньоекономічної та міжнародної діяльності підприємств з урахуванням особливостей здійснення міжнародної діяльності, у тому числі валютно-курсової політики.

ПРН 15 Вміти виявляти закономірності, умови та фактори національного та міжнародного характеру, зокрема у сфері валютно-курсової політики.

ПРН 16 Ідентифікувати та аналізувати можливий вплив сучасних трендів світової економіки на функціонування суб'єктів міжнародного бізнесу, зокрема тенденцій зміни валютних курсів

**Пререквізити навчальної дисципліни:** Стратегічне управління у міжнародному бізнесі, Менеджмент зовнішньоекономічної діяльності підприємств

**Постреквізити навчальної дисципліни:** Переддипломна практика, Робота над магістерською дисертацією.

## 2. Зміст навчальної дисципліни

- Тема 1. Міжнародна валютна система.
- Тема 2. Валютний курс
- Тема 3. Валютне регулювання та контроль. Платіжний баланс.
- Тема 4. Сутність та класифікація валютних операцій.
- Тема 5. Валютні операції типу «аутрайт» і «своп».
- Тема 6. Валютні ф'ючерси та опціони.
- Тема 7. Депозитні валютні операції.
- Тема 8. Управління валютними ризиками.
- Тема 9. Світовий валютний ринок.

## 3. Навчальні матеріали та ресурси

### Базова література

1. Бурковська А.В. Міжнародні кредитно-розрахункові та валютні операції в сучасних умовах: навч. посіб. / А.В. Бурковська, Т.І. Лункіна — К. : Центр учбової літератури, 2014. — 208 с.
2. Ковальчук К.Ф., Козенков Д.Є., Момот Ю.Г. Міжнародні кредитно-розрахункові та валютні операції: навчальний посібник. — К.: Центр учбової літератури, 2013. — 150 с.
3. Брюков В. Г. Как предсказать курс доллара. Эффективные методы прогнозирования с использованием Excel и EViews. — М., 2015
4. Міжнародні кредитно-розрахункові і валютні операції : навч. посіб. Для студ. спеціальності 073 «Менеджмент», спеціалізації «Менеджмент міжнародного бізнесу» / КПІ ім. Ігоря Сікорського ; уклад.: В.В. Дергачова, В.Я. Голук. — Київ: КПІ ім. Ігоря Сікорського, Вид-во «Політехніка», 2018. — 136 с.
5. Міжнародні розрахунки і валютні операції : навчальний посібник / О.В. Лебідь ; Міністерство освіти і науки України, Харківський національний економічний університет імені Семена Кузнеця. — Харків : ХНЕУ ім. С. Кузнеця, 2016. — 199 с.
6. Міжнародні кредитно-розрахункові та валютні операції: навчальний посібник / Л.Л. Носач, К.Ю. Величко, О.І. Печенка, Ж.С. Зосимова, Н.А. Сокол — Харків: Видавництво «Форт», 2016. — 240 с.
7. Найман Э. Малая энциклопедия трейдера / Эрик Л. Найман. — 11-е изд. — М.: 2016. — 459 с.
8. Рогач О. І. Світові фінанси: сучасні тенденції та перспективи розвитку : монографія / О. І. Рогач, О. В. Сніжко, З. О. Луцишин, І. І. Пузанов, В. І. Мазуренко; ред.: О. І. Рогач; Київ. нац. ун-т ім. Т. Шевченка. - Київ, 2013. - 351 с.

### Допоміжна

1. Арбузов С.Г. Банківська енциклопедія / С.Г.Арбузов, Ю.В.Колобов, В.І.Міщенко, С.В.Науменкова. — К.: Центр наукових досліджень Національного банку України: Знання, 2011. — 504 с.
2. Бондарчук М.К., Алексеев І.В., Кльоба Л.Г. Банківська система: навчальний посібник. — Львів: Ліга-Прес, 2017. — 246 с
3. Копилук О.І. Банківські операції: навчальний посібник/ О. І. Копилук, О. М. Музичка. - 2-ге вид. перероб. і доп.. - К.: Центр учбової літератури, 2012. - 536 с.
4. Международный финансовый рынок: учебник. — 2-е изд. перераб и доп. / под ред. д.э.н., проф. В. А. Слепова. — М. : Магистр : Инфра-М, 2014. — 368 с
5. Монетарна політика Національного банку України: сучасний стан та перспективи змін / За ред. В.С. Стельмаха. — К.: Центр наукових досліджень Національного банку України, УБС НБУ, 2009. — 404 с.
6. Шило В.П., Доровська С.С., Ільїна С.Б., Іванова Н.С. Міжнародні фінанси: Теоретично-практичний посібник. — К.: Кондор, 2010 р. — 346 с.
7. Энгдаль У.Ф. Боги денег: Уолл-Стрит и смерть Американского века.- С.-П.: Геликон плюс, 2011- 452 с.

### Інформаційні ресурси

1. Офіційна веб-сторінка Державної фінансової інспекції. Електронне джерело. Режим доступу: <http://www.dkrs.gov.ua/kru/uk/publish/article/84005>
2. Офіційна веб-сторінка Міністерства фінансів. Електронне джерело. Режим доступу: <http://www.minfin.gov.ua/news/bjudzhet>

3. Офіційна веб-сторінка Національної комісії з цінних паперів та фондового ринку. Електронне джерело. Режим доступу: <http://www.nssmc.gov.ua/about/description/mission>
4. Офіційний сайт Асоціації «УкрСВІФТ» [Електронний ресурс]. – Режим доступу: [http://ukrswift.org/index.php?lang\\_id=2&menu\\_id=1](http://ukrswift.org/index.php?lang_id=2&menu_id=1)
5. Офіційний сайт Національного банку України. [Електронний ресурс]. – Режим доступу: <http://www.bank.gov.ua>
6. Офіційний сайт Співтовариства всесвітніх міжбанківських фінансових телекомунікацій (Society for Worldwide Interbank Financial Telecommunication) [Електронний ресурс]. – Режим доступу: <http://www.swift.com/index.page?lang=en>
7. Офіційний сайт Української фондової біржі. [Електронний ресурс]. – Режим доступу: <http://ukrse.com.ua>
8. Офіційний сайт Української міжбанківської валютної біржі. [Електронний ресурс]. – Режим доступу: <https://www.uicegroup.com/>

## Навчальний контент

### 4. Методика опанування навчальної дисципліни (освітнього компонента)

Назви розділів і тем	Кількість годин				
	Всього	у тому числі			Вид навчальної діяльності
		Лекції	Практичні	СРС	
1	2	3	4		6
Тема 1. Міжнародна валютна система.	13	2	2	9	Тестування, круглий стіл
Тема 2. Валютний курс	13	2	2	9	Тестування, задачі
Тема 3. Валютне регулювання та контроль. Платіжний баланс.	13	2	1	10	Тестування, круглий стіл
Тема 4. Сутність та класифікація валютних операцій.	13	2	1	10	Тестування, круглий стіл
Тема 5. Валютні операції типу «аутрайт» і «своп».	14	2	2	10	Тестування, задачі
Тема 6. Валютні ф'ючерси та опціони.	14	2	2	10	Тестування, задачі
Тема 7. Депозитні валютні операції.	13	2	1	10	Тестування, задачі
Тема 8. Управління валютними ризиками.	13	2	1	10	Тестування, задачі
Тема 9. Світовий валютний ринок.	13	2	2	9	Тестування, круглий стіл
МКР	4	-	2	2	
Розрахункова робота	10	-	-	10	
Підготовка до заліку (Залік)	2	-	2		
<b>Всього годин</b>	<b>135</b>	<b>18</b>	<b>18</b>	<b>99</b>	

## 5. Самостійна робота студента/аспіранта

Самостійна робота студентів передбачає повторення лекційного матеріалу, самостійне опрацювання додаткових джерел, підготовку до практичних занять, розв'язування розрахункових завдань для закріплення навиків отриманих на практичних заняттях, проведення індивідуальних досліджень. Обсяги часу, що виділяється на СРС за темами дисципліни вказано у таблиці розділу 5 даного силабусу.

### Політика та контроль

## 6. Політика навчальної дисципліни (освітнього компонента)

### Відвідування занять та правила поведінки

Відвідування занять є обов'язковим. Однак у разі відсутності студент втрачає можливість заробити бали, які призначаються за результатами роботи студента на практичних заняттях: тестуванні, розв'язування розрахункових завдань, участь у обговореннях.

На території університету студенти повинні слідувати Правилам внутрішнього розпорядку «КПІ імені Ігоря Сікорського».

### Захист індивідуальних завдань

Основним індивідуальним завданням з дисципліни «Управління валютними операціями» є розрахункова робота, яка виконується протягом всього семестру згідно обраного завдання (студенти мають можливість обрати варіант завдання, однак варіанти у межах групи повинні відрізнитися). Розрахункова робота виконується за допомогою програм MS Excel, оформлюється згідно вимог ДСТУ 2015 і здається на перевірку за два тижні до останнього заняття.

### Дедлайни та пересладання

Студенти мають можливість перескладання контрольних заходів (тестування, МКР) у випадку представлення лікарняного листа, що підтверджує хворобу студента у день проведення контрольного заходу. У цьому випадку він має можливість пройти контрольний захід протягом наступного після хвороби тижня. Повторне перескладання контрольних заходів не передбачено.

### Заохочувальні та штрафні бали

Студенти можуть отримати заохочувальні бали студенти за презентації та доповіді з проблемних питань дисципліни. У випадку порушення термінів здачі розрахункових робіт студентам можуть нараховуватися штрафні бали.

### Академічна доброчесність

У випадку виявлення дублювання матеріалів у розрахункових роботах бали за ці роботи не нараховуються.

## 7. Види контролю та рейтингова система оцінювання результатів навчання (PCO)

### 1. Практичні заняття.

- «відмінно», повна відповідь (не менше 90% потрібної інформації) – 10 балів;
- «добре», достатньо повна відповідь (не менше 75% потрібної інформації), або повна відповідь з незначними неточностями – 8-9 балів;
- «задовільно», неповна відповідь (не менше 60% потрібної інформації) та незначні помилки – 6-7 балів;
- «незадовільно», незадовільна відповідь (не відповідає вимогам на «задовільно») – 0-5 балів.

Одному або двом кращим студентам на кожному практичному занятті може додаватися як заохочування 1 бал.

Загалом за практичні завдання можна отримати від 30 до 60

### 2. Модульна контрольна робота.

- «відмінно», повні відповіді на теоретичні запитання – 10 балів;
- «добре», присутні неточності в відповідях на теоретичні питання – 8-9 балів;

- «задовільно», робота містить відповіді на теоретичні запитання з несуттєвими неточностями – 5-7 балів;
- «незадовільно», незадовільна відповідь (не відповідає вимогам на «задовільно») – 0-4 балів.

### **3. Розрахункова робота**

- «відмінно», робота виконання в повному обсязі, розрахунки без помилок, з поясненнями и повними відповідями на поставлені питання – 26-30 балів;
- «добре», в роботі містяться деякі неточності або розрахункові помилки – 20-25 балів;
- «задовільно», є недоліки щодо виконання вимог до роботи і певні помилки – 15-19 балів;
- «незадовільно», не відповідає вимогам до «задовільно» – 0-14 балів.

Необхідною умовою допуску до заліку є написання МКР, зарахування розрахункової роботи.

За результатами навчальної роботи за перші 7 тижнів «ідеальний студент» має набрати 50-балів. На першій атестації (8-й тиждень) студент отримує «зараховано», якщо його поточний рейтинг не менше 30 балів.

За результатами 13 тижнів навчання «ідеальний студент» має набрати 50 балів (загалом 100 балів за весь семестр). На другій атестації (14-й тиждень) студент отримує «зараховано», якщо його загальний поточний рейтинг не менше 60.

Ті студенти, які бажають покращити рейтингові бали, набрані протягом семестру, можуть виконати письмову залікову контрольну роботу. Робота містить два завдання (практичні завдання виключно з переліку задач, які розв'язувалися на практичних заняттях). Залікові завдання оцінюються наступним чином 1\*20 балів (теоретичне завдання)+1\* 20 балів (практичне завдання).

#### ***Система оцінювання теоретичного питання:***

- «відмінно», повна відповідь (не менше 90% потрібної інформації) – 12-20 балів;
- «добре», достатньо повна відповідь (не менше 75% потрібної інформації, або незначні неточності) – 9-11 балів;
- «задовільно», неповна відповідь (не менше 60% потрібної інформації та деякі помилки) – 5-8 балів;
- «незадовільно», незадовільна відповідь – 0-4 балів.

#### ***Система оцінювання практичного завдання:***

- «відмінно», повне безпомилкове розв'язування завдання – 16-20 балів;
- «добре», повне розв'язування завдання з несуттєвими неточностями – 11-15 балів;
- «задовільно», завдання виконане з певними недоліками – 5-10 балів;
- «незадовільно», завдання не виконано – 0-4 балів.

Для отримання студентом відповідних оцінок (ECTS та традиційних) його рейтингова оцінка переводиться згідно з таблицею:

Бали	Оцінка за залік
95-100	відмінно
85-94	дуже добре
75-84	добре
65-74	задовільно
60-64	достатньо
Менше 60	незадовільно

## **8. Додаткова інформація з дисципліни (освітнього компонента)**

У разі введення карантинних обмежень на території університету викладання дисципліни може відбуватись у дистанційній формі за допомогою платформ Moodle, Zoom, Class-Time.

### **Робочу програму навчальної дисципліни (силабус):**

**Складено**

Професор кафедри менеджменту к.е.н. доцент Голюк Вікторія Ярославівна

доцент кафедри менеджменту к.е.н. доцент Голюк Вікторія Ярославівна

**Ухвалено** кафедрою менеджменту (протокол № 1 від 31.08.2021)

**Погоджено** Методичною комісією факультету (протокол №1 від 14.09.2021)