

Содержание

Введение

Тема 1. Основы функционирования валютных рынков

- 1.1. Национальная и мировая валютные системы, составляющие элементы
- 1.2. Этапы становления и развития мировой валютной системы
- 1.3. Валютный курс, факторы, его определяющие. Котировка валют
- 1.4. Понятие валютного рынка, его сущность и место на финансовом рынке. Участники валютного рынка, его основные функции
- 1.5. Признаки, классификации и виды валютного рынка. Особенности функционирования мирового валютного рынка

Тема 2. Валютный рынок России

- 2.1. Становление и развитие валютного рынка в России, особенности его функционирования
- 2.2. Институциональные и правовые основы функционирования валютного рынка России. Федеральный закон «О валютном регулировании и валютном контроле»
- 2.3. Административные и экономические методы регулирования валютного рынка. Основные принципы валютного контроля. Органы валютного регулирования и контроля, их функции и полномочия
- 2.4. Деятельность ММВБ, ее роль на внутреннем валютном рынке

Тема 3. Коммерческие банки как агенты валютного контроля

- 3.1. Уполномоченные коммерческие банки на валютном рынке России, их операции, требования, к ним предъявляемые
- 3.2. Полномочия и функции коммерческих банков как агентов валютного контроля
- 3.3. Порядок открытия и ведения валютных счетов резидентов, рублевых счетов нерезидентов
- 3.4. Паспорт сделки как основной документ валютного контроля
- 3.5. Валютный контроль за экспортно-импортными операциями

предприятий

Тема 4. Международные расчетно-платежные и гарантийные операции банков

- 4.1. Организация международных расчетов и платежей. Основные формы расчетов и способы платежа. Роль коммерческих банков в осуществлении международных расчетов
- 4.2. Банковский перевод: техника осуществления, особенности, характерные для международных платежных операций. Роль системы СВИФТ (SWIFT)
- 4.3. Инкассовая форма международных расчетов. Чистое и документальное инкассо. Основные этапы операции и документооборот. Преимущества и недостатки инкассовой формы международных расчетов
- 4.4. Понятие и виды аккредитивов. Основные этапы операций и документооборот при аккредитиве
- 4.5. Особенности международных расчетов с использованием векселей и чеков
- 4.6. Гарантийные операции банков. Виды гарантий, применяемых в международной банковской практике

Тема 5. Виды валютных сделок.

Сделки СПОТ

- 5.1. Классификация валютных операций
- 5.2. Котировка валюты: прямая, косвенная, кросс-курс
- 5.3. Кассовые конверсионные валютные сделки (СПОТ), цели и техника их проведения. Дата валютирования
- 5.4. Валютная позиция. Регулирование открытой валютной позиции.

Понятие валютного риска

Тема 6. Общая характеристика срочных валютных сделок. Форвардные валютные контракты

- 6.1. Понятие, виды, особенности срочных валютных сделок, их сравнительная характеристика
- 6.2. Рынок срочных валютных сделок: причины возникновения, субъекты и объекты
- 6.3. Курс срочных валютных сделок и факторы, его определяющие
- 6.4. Форвардные валютные контракты
- 6.5. Хеджирование валютных рисков с помощью срочных сделок

Тема 7. Валютные фьючерсы. Особенности организации фьючерсной торговли

- 7.1. Виды финансовых фьючерсов
- 7.2. Рынок финансовых фьючерсов, его отличительные особенности. Участники торгов
- 7.3. Механизм биржевой фьючерсной торговли
- 7.4. Первоначальный гарантийный депозит, вариационная и компенсационная маржа
- 7.5. Расчеты по фьючерсным контрактам. Расчетная палата и ее роль в организации фьючерсных торгов

Тема 8. Валютные опционы. Стратегии опционных сделок

- 8.1. Понятие и виды опционов, их отличие от других срочных сделок. Опционы «колл» и «пут», двойной опцион. Американский и европейский стили опционов
- 8.2. Рынок валютных опционов: биржевой и внебиржевой. Участники и цели заключения опционных сделок
- 8.3. Факторы, определяющие размер премии, внутренняя и временная стоимость опциона
- 8.4. Стратегии опционных сделок. Опционы с нулевой стоимостью

Тема 9. Операции СВОП. Арбитражные валютные операции

- 9.1. Валютные сделки СВОП. Репорт и депорт. Значение операции СВОП в

деле управления рисками

9.2. Арбитражные валютные сделки: понятие, особенности осуществления.

Пространственный, временной и конверсионный арбитраж.

Простой и сложный валютный арбитраж

9.3. Валютно-процентный покрытый и непокрытый валютный арбитраж

9 4. Понятие валютного дилинга, организация валютного дилинга
в коммерческих банках

Тесты

Глоссарий

Литература

Приложение