Затверджено науково-методичною

радою Державного університету «Житомирська політехніка»

протокол від «\_» \_\_\_\_\_\_20\_\_ р. № \_\_\_

**ТЕСТОВІ ЗАВДАННЯ**

з навчальної дисципліни

**“** **ПОХІДНІ ФІНАНСОВІ ІНСТРУМЕНТИ ”**

для студентів освітнього рівня «бакалавр»

денної та заочної форми навчання

спеціальності 072 «Фінанси, банківська справа та страхування»

освітньо-професійна програма «Фінанси, банківська справа та страхування»

факультет обліку і фінансів

кафедра фінансів і кредиту

Розглянуто і рекомендовано

на засіданні кафедри фінансів та кредиту

протокол від «28» серпня 2019 р. № 8

Розробник: доцент кафедри фінансів і кредиту Новак Оксана Сергіївна

Житомир

2019 – 2020 н.р.

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| *№ з/п* | Питання | Варіант відповіді | | |
| 1. | Що не відносять до деривативів: | А. ф’ючерсний контракт;  Б. опціон;  В. варант;  Г. аваль;  Д. своп?. | | |
| 2. | Цінні папери, механізм випуску та обігу яких пов'язаний з правом на придбання чи продаж упродовж строку, встановленого договором, цінних паперів, інших фінансових та/або товарних ресурсів, – це: | А. іпотечні сертифікати;  Б. облігації;  В. похідні цінні папери;  Г. казначейські зобов’язання України;  Д. акції. | | |
| 3 | Форвардний контракт – це: | А. цивільно-правовий договір, згідно з яким одна сторона контракту одержує право на придбання (продаж) базового активу, а інша ─ бере на себе безумовне зобов’язання продати (придбати) базовий актив у майбутньому впродовж строку дії опціону чи на встановлену дату (дату виконання) за визначеною під час укладання такого контракту ціною базового активу;  Б. стандартизований строковий контракт, за яким продавець зобов’язується у майбутньому в установлений строк передати базовий актив у власність покупця на визначених специфікацією умовах, а покупець зобов’язується прийняти базовий актив і сплатити за нього ціну, визначену сторонами контракту на дату його укладення;  В. цивільно-правова угода про здійснення обміну потоками платежів (готівкових або безготівкових) чи іншими активами, розрахованими на підставі ціни (котирування) базового активу в межах суми, визначеної договором на конкретну дату платежів (дату проведення розрахунків) упродовж дії контракту;  Г. цивільно-правовий договір, за яким продавець зобов’язується у майбутньому у встановлений строк передати базовий актив у власність покупця за визначених умов, а покупець зобов’язується прийняти у встановлений строк базовий актив і сплатити за нього ціну, визначену таким договором;  Д. немає правильної відповіді. | | |
| 4 | Ф’ючерсний контракт – це: | А. цивільно-правовий договір, згідно з яким одна сторона контракту одержує право на придбання (продаж) базового активу, а інша ─ бере на себе безумовне зобов’язання продати (придбати) базовий актив у майбутньому впродовж строку дії опціону чи на встановлену дату (дату виконання) за визначеною під час укладання такого контракту ціною базового активу;  Б. стандартизований строковий контракт, за яким продавець зобов’язується у майбутньому в установлений строк передати базовий актив у власність покупця на визначених специфікацією умовах, а покупець зобов’язується прийняти базовий актив і сплатити за нього ціну, визначену сторонами контракту на дату його укладення;  В. цивільно-правова угода про здійснення обміну потоками платежів (готівкових або безготівкових) чи іншими активами, розрахованими на підставі ціни (котирування) базового активу в межах суми, визначеної договором на конкретну дату платежів (дату проведення розрахунків) упродовж дії контракту;  Г. цивільно-правовий договір, за яким продавець зобов’язується у майбутньому у встановлений строк передати базовий актив у власність покупця за визначених умов, а покупець зобов’язується прийняти у встановлений строк базовий актив і сплатити за нього ціну, визначену таким договором;  Д. немає правильної відповіді. | | |
| 5 | Опціон – це: | А. цивільно-правовий договір, згідно з яким одна сторона контракту одержує право на придбання (продаж) базового активу, а інша ─ бере на себе безумовне зобов’язання продати (придбати) базовий актив у майбутньому впродовж строку дії опціону чи на встановлену дату (дату виконання) за визначеною під час укладання такого контракту ціною базового активу;  Б. стандартизований строковий контракт, за яким продавець зобов’язується у майбутньому в установлений строк передати базовий актив у власність покупця на визначених специфікацією умовах, а покупець зобов’язується прийняти базовий актив і сплатити за нього ціну, визначену сторонами контракту на дату його укладення;  В. цивільно-правова угода про здійснення обміну потоками платежів (готівкових або безготівкових) чи іншими активами, розрахованими на підставі ціни (котирування) базового активу в межах суми, визначеної договором на конкретну дату платежів (дату проведення розрахунків) упродовж дії контракту;  Г. цивільно-правовий договір, за яким продавець зобов’язується у майбутньому у встановлений строк передати базовий актив у власність покупця за визначених умов, а покупець зобов’язується прийняти у встановлений строк базовий актив і сплатити за нього ціну, визначену таким договором;  Д. немає правильної відповіді. | | |
| 6 | Своп – це: | А. цивільно-правовий договір, згідно з яким одна сторона контракту одержує право на придбання (продаж) базового активу, а інша ─ бере на себе безумовне зобов’язання продати (придбати) базовий актив у майбутньому впродовж строку дії опціону чи на встановлену дату (дату виконання) за визначеною під час укладання такого контракту ціною базового активу;  Б. стандартизований строковий контракт, за яким продавець зобов’язується у майбутньому в установлений строк передати базовий актив у власність покупця на визначених специфікацією умовах, а покупець зобов’язується прийняти базовий актив і сплатити за нього ціну, визначену сторонами контракту на дату його укладення;  В. цивільно-правова угода про здійснення обміну потоками платежів (готівкових або безготівкових) чи іншими активами, розрахованими на підставі ціни (котирування) базового активу в межах суми, визначеної договором на конкретну дату платежів (дату проведення розрахунків) упродовж дії контракту;  Г. цивільно-правовий договір, за яким продавець зобов’язується у майбутньому у встановлений строк передати базовий актив у власність покупця за визначених умов, а покупець зобов’язується прийняти у встановлений строк базовий актив і сплатити за нього ціну, визначену таким договором;  Д. немає правильної відповіді. | | |
| 7 | Які види деривативів є біржовими: | А. ф’ючерсний контракт та своп;  Б. ф’ючерсний та форвардний контракти;  В. форвардний контракт та опціон;  Г. ф’ючерсний контракт та опціон;  Д. лише своп? | | |
| 8 | Деривативи, базовим активом яких є ощадний(депозитний) сертифікат, називаються: | А. грошовими деривативами;  Б. деривативами з матеріальними активами;  В. деривативами з цінними паперами;  Г. деривативами з нематеріальними активами;  Д. немає правильної відповіді. | | |
| 9 | Деривативи, базовим активом яких є нерухоме майно, називаються: | А. грошовими деривативами;  Б. деривативами з матеріальними активами;  В. деривативами з цінними паперами;  Г. деривативами з нематеріальними активами;  Д. немає правильної відповіді. | | |
| 10 | Деривативи, базовим активом яких є промисловий зразок, називаються: | А. грошовими деривативами;  Б. деривативами з матеріальними активами;  В. деривативами з цінними паперами;  Г. деривативами з нематеріальними активами;  Д. немає правильної відповіді. | | |
| 11 | Стандартизованими деривативами є: | А. ф’ючерси;  Б. форварди;  В. свопи;  Г. немає вірної відповіді;  Д. немає правильної відповіді. | | |
| 12 | Форвардний контракт – це: | А. цивільно-правовий договір, згідно з яким одна сторона контракту одержує право на придбання (продаж) базового активу, а інша ─ бере на себе безумовне зобов’язання продати (придбати) базовий актив у майбутньому впродовж строку дії опціону чи на встановлену дату (дату виконання) за визначеною під час укладання такого контракту ціною базового активу;  Б. стандартизований строковий контракт, за яким продавець зобов’язується у майбутньому в установлений строк передати базовий актив у власність покупця на визначених специфікацією умовах, а покупець зобов’язується прийняти базовий актив і сплатити за нього ціну, визначену сторонами контракту на дату його укладення;  В. цивільно-правова угода про здійснення обміну потоками платежів (готівкових або безготівкових) чи іншими активами, розрахованими на підставі ціни (котирування) базового активу в межах суми, визначеної договором на конкретну дату платежів (дату проведення розрахунків) упродовж дії контракту;  Г. цивільно-правовий договір, за яким продавець зобов’язується у майбутньому у встановлений строк передати базовий актив у власність покупця за визначених умов, а покупець зобов’язується прийняти у встановлений строк базовий актив і сплатити за нього ціну, визначену таким договором;  Д. немає правильної відповіді. | | |
| 13 | Дата валютування — це за форвардним контрактом – це: | А. дата поставки коштів на рахунок контрагента;  Б. дата укладання угоди;  В. фіксація курсу національної одиниці в іноземній валюті на даний  момент;  Г. дата наступна за днем укладання контракту;  Д. немає правильної відповіді. | | |
| 14 | Річ, яку поклажодавець не забрав з ломбарду після закінчення … з дня закінчення строку договору зберігання, може бути продана ломбардом у порядку, встановленому законом (знайти пропущений текст): | А. двох місяців;  Б. трьох місяців;  В. чотирьох місяців;  Г. п’яти місяців;  Д. шести місяців. | | |
| 15 | Сторона, що буде сплачувати гроші за товар, сторона, що буде обмінювати гроші на товар, власник грошей у форвардному контракті називається: | А. Покупець;  Б. продавець;  В. посередник;  Г. біржа;  Д. всі відповіді правильні. | | |
| 16 | Період між датами укладання контракту та датою розрахунків за форвардом має назву: | А. дата валютування;  Б. дата укладання;  В. форвардний період;  Г. спред;  Д. немає правильної відповіді. | | |
| 17 | Дата валютування віддалена від дати укладання на: | А. дату спот + термін дії форвардної угоди;  Б. 1 день;  В. дату спот;  Г. термін дії форвардної угоди;  Д. немає правильної відповіді. | | |
| 18 | Форвардні контракти на реальну суму передбачають: | А. реальну поставку активу по закінченні форвардної угоди;  Б. перерахунок прибутку/збитку за контрактом залежно від спотових цін;  В. анулювання контракту до моменту його закінчення;  Г. немає правильної відповіді;  Д. всі відповіді правильні. | | |
| 19 | Проводиться виплата цінової різниці між ціною, що була зафіксована в момент укладання та в момент розрахунків: | А. за форвардом на реальну суму;  Б. за форвардом на умовну суму;  В. виключно за форвардом на золото;  Г. немає правильної відповіді;  Д. всі відповіді правильні. | | |
| 20 | Строк форвардного контракту встановлюється: | А. біржею;  Б. за домовленістю учасників;  В. лише продавцем;  Г. кліринговою палатою;  Д. всі відповіді правильні. | | |
| 21 | При форвардній угоді сума контракту визначається: | А. є стандартною;  Б. за домовленістю учасників;  В. лише продавцем;  Г. кліринговою палатою;  Д. немає правильної відповіді. | | |
| 22 | Громадянин або підприємець, який бажає укласти ф’ючерсний контракт, це:: | А. брокер;  Б. клієнт;  В. власник опціону;  Г. продавець опціону;  Д) немає правильної відповіді | | |
| 23. | Громадянин, який допущений до участі в торгах кліринговою палатою і виконує вимоги біржі в рамках правил торгів, називається: | А. дилер;  Б. брокер;  В. клієнт;  Г. товариства з додатковою відповідальністю;  Д) немає правильної відповіді | | |
| 24. | Вартість ф’ючерсу на кінець торгової сесії, яка визначається котирувальною комісією, називається: | А. розрахункова ціна позиції;  Б. поточна ціна позиції;  В. компенсаційна маржа;  Г. варіаційна маржа;  Д. всі відповіді правильні. | | |
| 25. | Ф’ючерсний контракт – це: | А. цивільно-правовий договір, згідно з яким одна сторона контракту одержує право на придбання (продаж) базового активу, а інша ─ бере на себе безумовне зобов’язання продати (придбати) базовий актив у майбутньому впродовж строку дії опціону чи на встановлену дату (дату виконання) за визначеною під час укладання такого контракту ціною базового активу;  Б. стандартизований строковий контракт, за яким продавець зобов’язується у майбутньому в установлений строк передати базовий актив у власність покупця на визначених специфікацією умовах, а покупець зобов’язується прийняти базовий актив і сплатити за нього ціну, визначену сторонами контракту на дату його укладення;  В. цивільно-правова угода про здійснення обміну потоками платежів (готівкових або безготівкових) чи іншими активами, розрахованими на підставі ціни (котирування) базового активу в межах суми, визначеної договором на конкретну дату платежів (дату проведення розрахунків) упродовж дії контракту;  Г. цивільно-правовий договір, за яким продавець зобов’язується у майбутньому у встановлений строк передати базовий актив у власність покупця за визначених умов, а покупець зобов’язується прийняти у встановлений строк базовий актив і сплатити за нього ціну, визначену таким договором;  Д. немає правильної відповіді. | | |
| 26. | До біржових деривативів відносять: | А. форварди;  Б. ф’ючерси;  В. опціони;  Г. свопи;  Д. всі відповіді правильні. | | |
| 27. | Базис це: | А. розмір плати (процентів), яка розподіляється на пайові членські внески та нараховується на внески (вклади), що знаходяться на депозитних рахунках членів кредитної спілки;  Б. розмір плати (процентів) за користування кредитами, наданими кредитною спілкою;  В. ціни (тарифи) на послуги, що надаються кредитною спілкою;  Г. види кредитів, що надаються кредитною спілкою, умови надання та строки повернення кредитів;  Д. всі відповіді правильні. | | |
| 28. | Кошти, що належать членам кредитної спілки, використовуються для: | А. фактична різниця між ціною ф’ючерсного контракту і спот-курсом базового активу;  Б. ліквідує попередню позицію, тобто зобов’язання відносно купівлі-продажу активу в день виконання;  В. контракт, згідно з яким у день виконання поставляється певна кількість іноземної валюти;  Г. всі відповіді правильні;  Д. немає правильної відповіді | | |
| 29. | Величина, нижче за яку значення початкової маржі не повинно опускатися протягом усього терміну відкритої позиції: | А. перерахування коштів з особистого рахунку;  Б. перерахування коштів з депозитного рахунку;  В. переказу коштів через пошту;  Г. внесення готівки через касу банку;  Д. всі відповіді правильні. | | |
| 30. | Банк з іноземним капіталом – це банк, у якому частка капіталу, що належить хоча б одному іноземному інвестору, становить не менше: | А прибуток;  Б. спред;  В. маржа;  Г. Компенсаційна маржа (маржа підтримання);  Д. всі відповіді правильні. | | |
| 31. | Хеджування ф’ючерсами це: | А. процес, завдяки якому мінімізується ціновий ризик зайняттям позиції на ф’ючерсному ринку, яка буде протилежною за напрямом, але дорівнюватиме за сумою балансовій позиції хеджера.  Б. співвідношення між вимогами в іноземній валюті та зобов’язаннями в іноземній валюті учасника валютного ринку;  В. процедура котирування, при якій визначаються і фіксуються міжнародний курс валют;  Г. обмінне співвідношення між двома валютними системами валютних курсів;  Д. немає правильної відповіді | | |
| 32 | При ф’ючерсній угоді сума контракту являється: | А. стандартною;  Б. встановлюється покупцем;  В. встановлюється за бажанням клієнта;  Г. встановлюється ф’ючерсною біржею;  Д. всі відповіді правильні | | |
| 33 | За ф’ючерсним контрактом терміни виконання встановлюються: | А. за згодою сторін;  Б. встановлюється покупцем;  В. встановлюється за бажанням клієнта;  Г. встановлюється ф’ючерсною біржею;  Д. всі відповіді правильні | | |
| 34. | Угода, за якою інвестор має право (а не обов’язок) придбати валюту на визначену дату у майбутньому, називається: | А. строкові угода;  Б. угода типу своп;  В. валютний опціон;  Г. угода з негайною поставкою;  Д. немає правильної відповіді | | |
| 35. | Особа, яка продає право на купівлю(«опціон кол») або продаж («опціон пут») валюти, називається: | А. власник опціону;  Б. продавець опціону;  В. брокер;  Г. дилер;  Д. всі відповіді правильні | | |
| 36. | Різниця між ринковою ціною опціону та його внутрішньою вартістю, називається: | А. надбавка до опціону;  Б. ціна виконання опціону;  В. внутрішня вартість опціону;  Г. компенсаційна маржа;  Д. немає правильної відповіді. | | |
| 37. | Право вирішувати, чи виконувати контракт має власник: | А. опціону;  Б. свопу;  В. ф’ючерсу;  Г. свопу;  Д. всі відповіді правильні | | |
| 38. | Кошти, які необхідно внести для укладення ф’ючерсного або опціонного контракту: | А. початкова маржа;  Б. варіаційна маржа;  В. підтримуюча маржа;  Г. валютна маржа;  Д. всі відповіді правильні | | |
| 39. | Різниця між тією величиною яку треба було б заплатити за валюту без опціону, та тією, яку платять скориставшись опціоном, називається: | А. премія до опціону;  Б. ціна виконання опціону;  В. внутрішня вартість опціону;  Г. немає правильної відповіді;  Д) всі відповіді правильні | | |
| 40. | Угоди за опціонами укладаються на: | А. біржовому ринку;  Б. міжнародному ринку;  В. міжбанківському ринку;  Г. відповіді а, в правильні;  Д немає правильної відповіді. | | |
| 41. | Опціон це: | А. угода між двома учасниками про обмін відсотковими платежами на визначену суму протягом певного періоду часу або обмін однієї валюти на іншу за умови, що через деякий час буде проведено обернену операцію;  Б. угода між продавцем (покупцем) фінансових інструментів, з одного боку, і кліринговою палатою ф’ючерсної біржі, з іншого, про поставку (прийняття) певної кількості базових активів за узгодженою вартістю на конкретну дату в майбутньому;  В. письмова угода, договір, за яким сторони, що його уклали, мають взаємні зобов'язання;  Г. угода, яка надає покупцеві право, але не зобов’язання на купівлю (продаж) базових активів за фіксованою ціною протягом деякого періоду в майбутньому або на визначену наперед дату в обмін на опціонну премію;  Д. договір між сторонами відносно виконання угоди на поставку біржового товару проти його оплати | | |
| 42. | Основною метою операцій з опціонами є: | А. спекулювання;  Б. отримання різниці у цінах на момент укладання угоди:  В. хеджування;  Г. відповіді а та в вірні;  Д. немає правильної відповіді; | | |
| 43. | Опціон європейський це: | А. опціон, що може бути реалізований у будь-який зручний для клієнта час протягом обумовленого періоду часу;  Б. опціон, реалізація якого може бути здійснена тільки в останній день терміну його дії;  В. контракт з опціоном, укладений двома учасниками, не стандартизований відносно ціни і дати закінчення терміну опціону;  Г. всі відповіді правильні;  Д. немає правильної відповіді. | | |
| 44. | Опціон американський це: | А. опціон, що може бути реалізований у будь-який зручний для клієнта час протягом обумовленого періоду часу;  Б. опціон, реалізація якого може бути здійснена тільки в останній день терміну його дії;  В. контракт з опціоном, укладений двома учасниками, не стандартизований відносно ціни і дати закінчення терміну опціону;  Г. всі відповіді правильні;  Д. немає правильної відповіді. | | |
| 45. | До компетенції загальних зборів учасників банку належить прийняття рішень щодо: | А) внесення змін та доповнень до статуту банку;  Б) контроль за операціями банку;  В) умов праці та матеріального стимулювання членів правління банку;  Г) визначення зовнішнього аудитора;  Д) немає правильної відповіді | | |
| 46. | Операції своп – комбінація двох протилежних конверсійних операцій на однакову суму з однією датою укладання та різними датами валютування. При цьому: | А. обидві операції повинні бути терміновими;  Б. одна із вказаних операцій повинна бути терміновою, а інша – угодою з негайною поставкою;  В. операції не є терміновими;  Г. всі відповіді правильні;  Д. немає правильної відповіді. | | |
| 47. | На міжнародному ринку капіталів своп має наступні значення: | А. здійснення одночасних купівлі та продажу валюти;  Б. одночасне надання кредитів у різних валютах;  В. здійснення продажу валюти;  Г. надання кредитів в одній валюті;  Д. всі відповіді правильні | | |
| 48. | Свопові операції використовуються і для зменшення та уникнення валютних ризиків, пов’язаних з: | А. довгостроковими негативними економічними тенденціями;  Б. короткостроковими коливаннями валютних курсів;  В. тривалими коливаннями валютних курсів;  Г. всі відповіді правильні;  Д. немає правильної відповіді. | | |
| 49. | Угоди «своп» передбачають право будь-якої із сторін достроково розірвати угоду в таких випадках:: | А) у разі невиконання будь-якою із сторін своїх зобов'язань за угодою (default);  Б. у разі виникнення непередбачених обставин (force majeure);  В. у разі недотримання своїх зобов’язань,  Г. всі відповіді правильні;  Д. немає правильної відповіді. | | |
| 50. | Основними цілями операції своп є: | А. придбання банком готівки в одній валюті за рахунок надлишку іншої валюти та зменшення (нейтралізація) валютних ризиків при проведенні форвардних угод;  Б. пролонгування (продовження) відкритої валютної позиції; в) закриття валютної позиції;;  4) правління (рада директорів) банку | | |
| 51. | Операція«своп» - це валютна операція: | А. спот;  Б. строкова;  В. нелімітована;  Г. довгострокова;  Д. всі відповіді правильні | | |
| 52. | Що таке валютний своп? | А. це комбінація двох протилежних конверсійних товарних угод на однакову суму з різними датами валютування;  Б. це обмін потоками двох валют за певний період у майбутньому між сторонами угод;  В. це папір визначеної форми, де вказують всі параметри угоди;  Г. немає правильної відповіді;  Д. всі відповіді правильні | | |
| 53. | Що таке процентний своп? | А. це папір визначеної форми, де вказують всі параметри угоди;  Б. це обмін потоками двох валют за певний період у майбутньому між сторонами угод;  В. це комбінація двох протилежних конверсійних угод на однакову суму з різними датами валютування;  Г. це обмін між двома (або більшою кількістю сторін) процентними платежами або надходженнями;  Д. немає правильної відповіді. | | |
| 54. | Опціон, що може бути виконаний в будь-який із визначених днів протягом його дії, це: | А. американський опціон;  Б. європейський опціон;  В. бермудський опціон;  Г. тихоокеанський опціон;  Д. немає правильної відповіді. | | |
| 55. | За бінарним опціоном «все або нічого» виплати здійснюються: | А. якщо він виявиться вигідним в момент виконання;  Б. в момент укладання;  В. якщо він виявиться вигідним в будь-який момент строку його дії;  Г. всі відповіді вірні;  Д. немає правильної відповіді. | | |
| 56. | Опціон, що в де-який день в майбутньому (але не в день виконання) дозволяє власнику визначити його вид: пут чи колл, називається: | А. американський опціон;  Б. європейський опціон;  В. бермудський опціон;  Г. тихоокеанський опціон;  Д. опціон з вибором | | |
| 57. | Цінний папір, який випускається емітентом разом із власними привілейованими акціями чи облігаціями та надає його власникові право на придбання простих акцій даного емітента протягом певного періоду на заздалегідь узгоджених умовах: | А. американський опціон;  Б. варант;  В. бермудський опціон;  Г. тихоокеанський опціон;  Д. немає правильної відповіді. | | |
| 58. | Звичайний європейський опціон, але він припиняє своє існування, як тільки ціна базисного активу досягає деякої бар'єрної ціни, називається: | А. американський опціон;  Б.опціон нок-аут;  В. бермудський опціон;  Г. опціон нок-ін;  Д. немає правильної відповіді. | | |
| 59. | Опціон, що не починає діяти доти, поки ціна базисного активу не досягне бар'єрної ціни: | А. американський опціон;  Б.опціон нок-аут;  В. бермудський опціон;  Г. опціон нок-ін;  Д. немає правильної відповіді. | | |
| 60 | Двостороння угода, яка надає право покупцеві опціону на одержання компенсації в разі перевищення ринкової ставки над попередньо зафіксованим рівнем відсоткової ставки в розрахунку на умовну суму протягом певного періоду в майбутньому, це: | А. кеп;  Б. флор;  В. бермудський опціон;  Г. опціон нок-ін  Д. всі відповіді правильні | | |
| 61. | Угода, яка надає право її покупцеві одержати компенсацію в разі зниження ринкових ставок нижче попередньо зафіксованого рівня в розрахунку на обумовлену суму протягом деякого періоду в майбутньому: | А. кеп;  Б. флор;  В. бермудський опціон;  Г. опціон нок-ін  Д. всі відповіді правильні | | |
| 62. | Опціон на укладення операції своп на певних умовах, це: | А. свопціон;  Б. флор;  В. бермудський опціон;  Г. опціон нок-ін  Д. всі відповіді правильні | | |
| 63. | Кредитний договір укладається: | | А. тільки у письмовій формі;  Б. шляхом усної домовленості;  В. як в письмовій, так і в усній формі;  Г. в залежності від домовленості між кредитором та позичальником, інвестиції, основні засоби і товарно-матеріальні цінності;  Д. всі відповіді правильні | |
| 64. | Позичковий капітал банку у грошовій формі, що передається у тимчасове користування на умовах забезпеченості, повернення, строковості, платності та цільового характеру використання, має назву: | | А) депозит;  Б) кредит;  В) облігація;  Г) інвестиція;  Д) позика | |
| 65. | Особливий вид економічних відносин щодо надання кредитів під заставу нерухомого майна має назву: | | А) комерційний кредит;  Б) іпотечний кредит;  В) споживчий кредит;  Г) лізинговий кредит;  Д) банківський кредит | |
| 66. | Кредитний дериватив (своп), угода, згідно з якою покупець на основі разових або регулярних внесків сплачує премію за кредитний ризик емітентові, який бере на себе зобов’язання погасити виданий покупцем кредит третій стороні в разі неможливості погашення кредиту боржником (дефолт третьої сторони): | | А. опціон;  Б. кредитна нота;  В. кредитно-дефолтний своп;  Г. кредитний опціон;  Д. всі відповіді правильні | |
| 67. | Інструмент, що дозволяє оригінатору придбати захист для цілого пакету запозичень (кредитного портфеля), а інвестор зобов’язується покрити збиток при настанні кредитної події хоча б за одним із видів активів, це: | | А. кошиковий (пакетний) своп на невиконання;  Б. кредитна нота;  В. кредитно-дефолтний своп;  Г. кредитний опціон;  Д. всі відповіді правильні | |
| 68. | Базовим активом за кредитними опціонами може виступати: | | А. ціна за плаваючу відсоткову ставку за облігаціями чи іншими фінансовими інструментами;  Б. ціна на пакет з “обміну активами”, який включає в себе кредитний інструмент та відповідний похідний контракт, за яким грошові потоки, що генеруються цим інструментом, обмінюються на плаваючу ставку грошових надходжень;  В. валюта;  Г. правильні відповіді а і б;  Д. немає правильної відповіді. | |
| 69. | Емісійний цінний папір, що надає право її власнику на отримання від емітента кредитної ноти в передбачений в ній термін її номінальної вартості та фіксованого відсотка від номінальної вартості, у випадку, якщо не відбулася жодна з кредитних подій, передбачених у рішенні про їх випуск: | | А. кошиковий (пакетний) своп на невиконання;  Б. кредитна нота;  В. кредитно-дефолтний своп;  Г. кредитний опціон;  Д. немає правильної відповіді. | |
| 70. | Позабалансові фінансові інструменти, що дозволяють одній стороні (бенефіціару) перенести кредитний ризик по активу гаранту, не вдаючись до фізичного продажу активу, це : | | А. гібридні цінні папери;  Б. пайові цінні папери;  В. боргові цінні папери;  Г. деривативи;  Д. немає правильної відповіді | |
| 71. | Кредитні ризики можуть мінімізуватися за допомогою відповідного забезпечення, до якого відносяться: | | А. неустойка (штрафи, пеня);  Б. застава;  В. порука (гарантія);  Г. всі відповіді правильні;  Д. немає правильної відповіді | |
| 72. | Захід, спрямований на мінімізацію втрат від кредитного ризику, що полягає у встановленні межі кредиту, називається: | | А. хеджування;  Б. лімітування;  В. страхування;  Г. дотримання нормативів кредитного ризику;  Д. немає правильної відповіді | |
| 73. | Активом за кредитним деривативом може бути: | | А. пул фінансових активів;  Б. валюта;  В. курс,  Г. акції;  Д. немає правильної відповіді | |
| 74. | Використання деривативів шляхом відкриття/закриття та збереження відкритих позицій по ним з метою управління ризиком зміни ринкової вартості цінних паперів, а також валютними та процентними ризиками, пов’язаними з операціями на фондовому ринку, це: | | А. хеджування;  Б. страхування;  В. диверсифікація;  Г. спекуляція;  Д. всі відповіді правильні | |
| 75. | Сукупність зареєстрованих на ім'я учасника біржової торгівлі деривативів, зобов'язання за якими ще не виконані, це: | | А. відкрита позиція;  Б. закрита позиція;  В. рахунок в деривативах;  Г. немає правильної відповіді;  Д. всі відповіді правильні | |
| 76. | Пропозиція одного учасника торгівлі укласти біржову угоду з іншим учасником торгівлі, зафіксована біржею, це: | | А. відкрита позиція;  Б. закрита позиція;  В. оферта;  Г. немає правильної відповіді;  Д. всі відповіді правильні | |
| 77. | Сторона, яка згодна придбати актив за попередньо визначеною ціною в майбутньому, займає: | | А. відкриту коротку позицію;  Б. відкриту довгу позицію;  В. закриту позицію;  Г. немає правильної відповіді.;  Д. всі відповіді правильні | |
| 78. | Сторона, яка згодна продати актив за попередньо визначеною ціною в майбутньому, займає: | | А. відкриту коротку позицію;  Б. відкриту довгу позицію;  В. закриту позицію;  Г. немає правильної відповіді.;  Д. всі відповіді правильні | |
| 79. | Страхування ризику від одного фінансового інструмента придбанням ф'ючерса або опціону на інший фінансовий інструмент, це: | | А. хеджування;  Б. страхування;  В. диверсифікація;  Г. перехресне хеджування;  Д. інвестиції | |
| 80. | За способом випуску ощадні сертифікати поділяються на: | | А) термінові та до запитання;  Б) іменні, на пред’явника;  В) з разовою сплатою, в день погашення;  Г) одноразові, серіями;  Д. всі відповіді правильні | |
| 81. | Якщо учасник має відкриту коротку позицію (продаж контракту), він може її закрити шляхом: | | А. відкриття короткої позиції;  Б. очікування виконання;  В. відкриття довгої позиції (купівля контракту);  Г. немає правильної відповіді;  Д. всі відповіді правильні | |
| 82. | Особа, яка страхує на строковому ринку свої фінансові активи або результати угод, здійснених на спотовому ринку, це: | | А. хеджер;  Б. спекулянт;  В. арбітражер;  Г. брокер;  Д. немає правильної відповіді | |
| 83. | Особа, яка намагається отримати прибуток за рахунок змін цін на строковому ринку, це: | | А. хеджер;  Б. спекулянт;  В. арбітражер;  Г. брокер;  Д. правильної відповіді немає | |
| 84. | Особа, яка отримує прибуток за рахунок одночасної купівлі-продажу одного й того самого активу на різних ринках, це: | | А. хеджер;  Б. спекулянт;  В. арбітражер;  Г. брокер;  Д. правильної відповіді немає. | |
| 85. | Письмове свідоцтво банку про депонування грошових коштів, яке засвідчує право власника сертифіката або його правонаступника на одержання після закінчення встановленого строку суми вкладу та процентів, установлених сертифікатом, у банку, який його видав, – це: | | А) іпотечний сертифікат;  Б) вексель;  В) чек;  Г) ощадний сертифікат;  Д) акція | |
| 86. | Ринковий ризик у торгівлі деривативами включає такі види ризиків: | | А. фондовий ризик (зміна ціни цінного паперу);  Б. валютний;  В. відсотковий;  Г. товарний;  Д. всі відповіді правильні | |
| 87. | Договір, що засвідчує право комерційного банку управляти залученими від юридичних і фізичних осіб коштами та право вкладників отримати в чітко визначений строк суму депозитного вкладу, і відсотки за його користування, це: | | А) інвестиційний;  Б) кредитний;  В) депозитний;  Г) лізингу;  Д) довірчого управління активами | |
| 88. | Ризик того, що контрагент не виконає своїх зобов’язань за контрактом, це: | | А. ризик дефолту;  Б. ризик валютний;  В. відсотковий ризик;  Г. товарний ризик;  Д. всі відповіді правильні | |
| 89. | Ризик, що проявляється у відсутності можливості швидко придбати або продати актив без суттєвих втрат, це: | | А. ризик дефолту;  Б. ризик ліквідності;  В. відсотковий ризик;  Г. товарний ризик;  Д. всі відповіді правильні | |
| 90. | Ризик збитку в результаті неадекватних чи помилкових внутрішніх процесів, дій співробітників тощо, це: | | А. ризик дефолту;  Б. ризик валютний;  В. операційний ризик;  Г. товарний ризик;  Д. всі відповіді правильні | |
| 91. | Ризик збитків внаслідок несприятливої зміни ринкових котировок цінних паперів та похідних фінансових інструментів під впливом факторів, пов’язаних як з емітентом цінних паперів та похідних фінансових інструментів, так і з загальними коливаннями ринкових цін на фінансові інструменти, це: | | А. фондовий ризик (зміна ціни цінного паперу);  Б. валютний;  В. відсотковий;  Г. товарний;  Д. всі відповіді правильні | |
| 92. | Наявний або потенційний ризик для надходжень і капіталу, який виникає через несприятливі коливання курсів іноземних валют і цін на банківські метали, це: | | А. ризик дефолту;  Б. ризик валютний;  В. операційний ризик;  Г. товарний ризик;  Д. всі відповіді правильні | |
| 93. | Імовірність того, що вартість фінансового інструмента буде змінюватися внаслідок змін відсоткових ставок, це: | | | А. фондовий ризик (зміна ціни цінного паперу);  Б. валютний;  В. відсотковий;  Г. товарний;  Д. всі відповіді правильні |
| 94. | Імовірність цінових змін внаслідок валютного, відсоткового та ринкового ризиків, це: | | | А. фондовий ризик (зміна ціни цінного паперу);  Б. валютний ризик;  В. відсотковий ризик;  Г. товарний ризик;  Д. ціновий ризик |
| 95. | Юридична особа, яка провадить клірингову діяльність, набуває взаємні права та обов’язки сторін правочинів щодо цінних паперів, зобов’язання за якими допущені до клірингу, та стає покупцем для кожного продавця і продавцем для кожного покупця, – це: | | | А. фондова біржа;  Б. центральний контрагент;  В. трейдер;  Г. хеджер;  Д. немає правильної відповіді |
| 96. | Припинення зобов'язань сторін без необхідності передачі активів (цінних паперів, деривативів, дорогоцінних металів, грошових коштів тощо), які виступають предметом зобов'язання в рамках декількох договорів чи однієї генеральної угоди: | | | А. неттінг;  Б. хеджування;  В. страхування;  Г. диверсифікація;  Д. немає правильної відповіді |
| 97. | Цінний папір, який розміщується інвестиційним фондом, інвестиційною компанією, компанією з управління активами пайового інвестиційного фонду та посвідчує право власності інвестора на частку в інвестиційному фонді, взаємному фонді інвестиційної компанії та пайовому інвестиційному фонді, має назву: | | | А. акція;  Б. облігація;  В. інвестиційний сертифікат;  Г. вексель;  Д. немає правильної відповіді |
| 98. | Вартісний вираз права на придбання або продаж окремого об'єкта державного цінового регулювання на строкових умовах, це: | | | А. базовий актив;  Б. маржа;  В. базисна умова поставки;  Г. немає правильної відповіді;  Д. всі відповіді правильні |
| 99. | Визначена у міжнародній практиці система взаємних зобов'язань партнерів з поставки товарних мас; встановлює момент переходу від продавця до покупця ризиків пошкодження чи їх загибелі, – це: | | | А. базовий актив;  Б. маржа;  В. базисна умова поставки;  Г. немає правильної відповіді;  Д. всі відповіді правильні |
| 100. | Пропозиція від покупця купити товар або контракт за конкретною ціною, називається: | | | А. базовий актив;  Б. маржа;  В. бід;  Г. немає правильної відповіді;  Д. вексель |
| 101. | Сучасна форма біржі товарної, торгівля на якій здійснюється ф'ючерсними контрактами – це: | | | А. фондова біржа;  Б. електронна біржа;  В. нафтова біржа;  Г. Біржа ф'ючерсна;  Д. всі відповіді правильні |
| 102. | Офіційний час роботи біржі, протягом якого укладаються угоди, це: | | | А. Біржова сесія;  Б. біржова спекуляція;  В. термін існування біржі;  Г. всі відповіді правильні.;  Д. всі відповіді правильні |
| 103. | Здійснення на біржі угод з метою одержання прибутку на різниці між курсами (або ціною) купівлі та продажу, має назву: | | | А. Біржова сесія;  Б. біржова спекуляція;  В. термін існування біржі;  Г. всі відповіді правильні.;  Д. всі відповіді правильні |
| 104. | Укладення торговцем цінними паперами цивільно-правових договорів щодо цінних паперів від свого імені та за свій рахунок з метою перепродажу – це: | | | А. дилерська діяльність;  Б. брокерська діяльність;  В. діяльність з управління іпотечним покриттям;  Г. діяльність з управління активами;  Д. всі відповіді правильні |
| 105. | Сума грошей, що є обумовленою частиною загальної вартості ф'ючерсного контракту або твердою сумою, яка має бути сплачена членом біржі розрахунковій палаті, а клієнтами – брокеру, коли контракт зареєстровано, називається: | | | А. депозит;  Б. кредит;  В. кліринг;  Г. неттінг;  Д. всі відповіді правильні |
| 106. | Показник, що характеризує зміну біржового курсу цінних паперів чи цін групи товарів на певну дату, це: | | | А. Індекс біржовий;  Б. обсяг капріталізації;  В. диференція;  Г. арбітраж;  Д. усі відповіді правильні |