

Документ подписан простой электронной подписью

Информационно-образовательное учреждение высшего образования  
Негосударственное аккредитованное некоммерческое частное образовательное учреждение высшего образования

ФИО: Агабекян Раиса Левоновна

образования

Должность: ректор «Академия маркетинга и социально-информационных технологий – ИМСИТ»

Дата подписания: 30.05.2023 16:33:41

(г. Краснодар)

Уникальный программный ключ:

(НАН ЧОУ ВО Академия ИМСИТ)

4237c7ccb9b9e111bbaf1f4fcd9201d015c4dbaa123ff774747307b9b9fbcbe

УТВЕРЖДАЮ

Проректор по учебной работе,

доцент Севрюгина Н.И.

17 апреля 2023

## Структурное финансирование и финансовые технологии

### Анотация к рабочей программе дисциплины (модуля)

Закреплена за кафедрой **Кафедра бизнес-процессов и экономической безопасности**

Учебный план 38.04.08 Финансы и кредит

Квалификация **магистр**

Форма обучения **очная**

Программу составил(и):

#### Распределение часов дисциплины по семестрам

Семестр (<Курс>.<Семестр на курсе>)	3 (2.1)		Итого	
	12 5/6			
Неделя				
Вид занятий	УП	РП	УП	РП
Лекции	12	12	12	12
Практические	24	24	24	24
Контактная работа на аттестации	0,2	0,2	0,2	0,2
В том числе инт.	14	14	14	14
В том числе в форме практ.подготовки	2		2	
Итого ауд.	36	36	36	36
Контактная работа	36,2	36,2	36,2	36,2
Сам. работа	71,8	71,8	71,8	71,8
Итого	108	108	108	108

### 1. ЦЕЛИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

1.1	является формирование компетенций студентов, обучающихся по направлению подготовки 38.04.08 Финансы и кредит. Дисциплина нацелена получение студентами общих представлений о развитии новых финансовых технологий, понимание закономерностей развития финансовой революции и новых финансовых технологий, развитие навыков проведения самостоятельной исследовательской и аналитической работы и использование финансовых технологий и новых финансовых инструментов для решения конкретных проблем, связанных с проблемами финансовых рынков и использования финансовых инструментов корпорациями
-----	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

### 2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ООП

Цикл (раздел) ООП:		Б1.В
<b>2.1</b>	<b>Требования к предварительной подготовке обучающегося:</b>	
2.1.1	Производные и финансовые инструменты	
2.1.2	Портфельные теории и управление активами	
2.1.3	Учебная практика: научно-исследовательская работа	
<b>2.2</b>	<b>Дисциплины и практики, для которых освоение данной дисциплины (модуля) необходимо как предшествующее:</b>	
2.2.1	Корпоративная финансовая политика	
2.2.2	Венчурный бизнес и венчурное финансирование	
2.2.3	Венчурный бизнес и венчурное финансирование	
2.2.4	Анализ и управление рисками	
2.2.5	Производственная практика: практика по профилю профессиональной деятельности	
2.2.6	Производственная практика: научно-исследовательская работа	
2.2.7	Производственная практика: преддипломная практика	
2.2.8	Подготовка к процедуре защиты и защита выпускной квалификационной работы	

### 3. КОМПЕТЕНЦИИ ОБУЧАЮЩЕГОСЯ, ФОРМИРУЕМЫЕ В РЕЗУЛЬТАТЕ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

**ПК-3: Способность использовать новые финансовые инструменты для решения конкретных прикладных задач, связанных с проблемами финансовых рынков и использования финансовых инструментов корпорациями**

**ПК-3.1: Составляет и согласовывает инвестиционный портфель клиента, определяет и согласовывает правила информирования клиента и критерии взаимодействия с клиентом; презентует согласованные финансовые решения клиенту**

**Знать:**

основы инвестирования, основы формирования инвестиционного портфеля клиента, правила информирования клиента и критерии взаимодействия с клиентом минимальный необходимый уровень

основы инвестирования, основы формирования инвестиционного портфеля клиента, правила информирования клиента и критерии взаимодействия с клиентом средний необходимый уровень

основы инвестирования, основы формирования инвестиционного портфеля клиента, правила информирования клиента и критерии взаимодействия с клиентом высокий уровень

**Уметь:**

составлять и согласовывать инвестиционный портфель клиента, определять и согласовывать правила информирования клиента и критерии взаимодействия с клиентом; презентовать согласованные финансовые решения клиенту минимальный необходимый уровень

составлять и согласовывать инвестиционный портфель клиента, определять и согласовывать правила информирования клиента и критерии взаимодействия с клиентом; презентовать согласованные финансовые решения клиенту средний необходимый уровень

составлять и согласовывать инвестиционный портфель клиента, определять и согласовывать правила информирования клиента и критерии взаимодействия с клиентом; презентовать согласованные финансовые решения клиенту высокий уровень

**Владеть:**

методикой составления и технологией согласования в сфере инвестирования и формирования инвестиционного портфеля клиента

способностью определять и согласовывать правила информирования клиента и критерии взаимодействия с клиентом

способностью составления и технологией согласования в сфере инвестирования и формирования инвестиционного портфеля клиента; определять и согласовывать правила информирования клиента и критерии взаимодействия с клиентом; технологий создания презентации по финансовым решениям клиенту

**ПК-3.2: Выявляет качественные и количественные свойства рисков; составляет перечень рекомендаций по управлению инвестиционным риском в предполагаемых к использованию финансовых продуктах**



теоретические основы организации экспертизы
общие положения по привлечению независимых внешних консультантов и экспертов в области финансовых рынков для решения задач финансового планирования
<b>Уметь:</b>
инициировать привлечение независимых внешних консультантов и экспертов в области финансовых рынков
привлекать независимых внешних консультантов и экспертов в области финансовых рынков
привлекать независимых внешних консультантов и экспертов в области финансовых рынков к решению задач финансового планирования
<b>Владеть:</b>
методами решения задач финансового планирования
способами организации экспертизы
методами решения задач финансового планирования и способами организации экспертизы независимыми внешними консультантами и экспертами в области финансовых рынков
<b>ПК-3.5: Анализирует финансовое положение клиента на предмет выявления несоответствия текущего финансового состояния клиента его финансовым целям</b>
<b>Знать:</b>
теоретические основы финансового анализа
основные методы оценки финансового положения клиента
теоретические основы финансового анализа и основные методы оценки финансового положения клиента на предмет выявления несоответствия текущего финансового состояния клиента его финансовым целям
<b>Уметь:</b>
анализировать финансовое положение клиента
проводить анализ текущего финансового состояния клиента
анализировать финансовое положение клиента и проводить анализ текущего финансового состояния клиента на предмет выявления несоответствия текущего финансового состояния клиента его финансовым целям
<b>Владеть:</b>
способностью анализировать финансовое положение клиента
способностью проводить анализ текущего финансового состояния клиента
способностью анализировать финансовое положение клиента и проводить анализ текущего финансового состояния клиента на предмет выявления несоответствия текущего финансового состояния клиента его финансовым целям
<b>ПК-3.6: Подбирает классы активов и финансовых продуктов в соответствии с потребностями клиента</b>
<b>Знать:</b>
инструменты управления активами и финансовыми продуктами
потребности клиента
инструменты управления активами и финансовыми продуктами в соответствии с потребностями клиента
<b>Уметь:</b>
применять инструментарий управления активами и финансовыми продуктами
выявлять потребности клиента
подбирать классы активов и финансовых продуктов в соответствии с потребностями клиента
<b>Владеть:</b>
способностью применять инструментарий управления активами и финансовыми продуктами
способностью выявлять потребности клиента
способностью подбирать классы активов и финансовых продуктов в соответствии с потребностями клиента
<b>ПК-3.7: Проводит стресс-тесты и сценарный анализ, по результатам которого моделирует целевой портфель клиента</b>
<b>Знать:</b>
общие положения стресс-тестирования и сценарного анализа
алгоритм моделирования целевого портфеля клиента
общие положения с стресс-тестирования и сценарного анализа и алгоритм моделирования целевого портфеля клиента
<b>Уметь:</b>
проводить стресс-тесты и сценарный анализ
разрабатывать алгоритм моделирования целевого портфеля клиента
проводить стресс-тесты и сценарный анализ и разрабатывать алгоритм моделирования целевого портфеля клиента
<b>Владеть:</b>

технологией стресс-тестирования и методами сценарного анализа
способностью разрабатывать алгоритм моделирования целевого портфеля клиента
технологией стресс-тестирования и методами сценарного анализа и способностью разрабатывать алгоритм моделирования целевого портфеля клиента

**ПК-3.8: Формирует финансовый план и критерии мониторинга его выполнения, определяете критерии оценки эффективности финансового плана и качества инвестиционного портфеля клиента, разрабатывает программу его оптимизации**

<b>Знать:</b>
теоретические основы финансового планирования и критерии мониторинга его выполнения
критерии оценки эффективности финансового плана и качества инвестиционного портфеля клиента
основы финансового планирования и критерии мониторинга его выполнения, критерии оценки эффективности финансового плана и качества инвестиционного портфеля клиента, алгоритм разработки программы его оптимизации
<b>Уметь:</b>
формировать финансовый план и критерии мониторинга его выполнения
определять критерии оценки эффективности финансового плана и качества инвестиционного портфеля клиента
формировать финансовый план и критерии мониторинга его выполнения, определять критерии оценки эффективности финансового плана и качества инвестиционного портфеля клиента и разрабатывать программу его оптимизации
<b>Владеть:</b>
методами финансового планирования и способами выбора критерий мониторинга его выполнения
способностью определять критерии оценки эффективности финансового плана и качества инвестиционного портфеля клиента
способностью формировать финансовый план и критерии мониторинга его выполнения, определять критерии оценки эффективности финансового плана и качества инвестиционного портфеля клиента и разрабатывать программу его оптимизации

**ПК-3.9: Анализирует, пересматривает (ребалансирует) состав активов, изменения стоимости капитала инвестиционного портфеля клиента**

<b>Знать:</b>
этапы и принципы формирования инвестиционного портфеля клиента
основы оценки эффективности инвестиционного портфеля клиента
основные положения о доходности и риску инвестиционного портфеля клиента
<b>Уметь:</b>
формировать инвестиционный портфель клиента
выбирать активы инвестиционного портфеля клиента
определять стоимость капитала инвестиционного портфеля клиента
<b>Владеть:</b>
методикой формирования инвестиционного портфеля клиента
способами расчёта доходности инвестиционного портфеля,
способами проведения анализа изменения стоимости капитала инвестиционного портфеля

**ПК-3.10: Составляет прогноз денежного потока, с детальным анализом использования заемных средств (кредитные продукты)**

<b>Знать:</b>
общие положения о денежном потоке
общие положения о заемных средствах
особенности прогнозирования денежного потока
<b>Уметь:</b>
составлять прогноз денежного потока
анализировать использование заемных средств
составлять прогноз денежного потока и анализировать использование заемных средств (кредитных продуктов)
<b>Владеть:</b>
методикой составления прогноза денежного потока
способностью анализировать использование заемных средств
методикой составления прогноза денежного потока и способностью анализировать использование заемных средств (кредитных продуктов)

**В результате освоения дисциплины обучающийся должен**

<b>3.1</b>	<b>Знать:</b>
основы инвестирования, основы формирования инвестиционного портфеля клиента, правила информирования клиента и критерии взаимодействия с клиентом минимальный необходимый уровень	
качественные и количественные свойства рисков; основы управления инвестиционным риском в предполагаемых к использованию финансовых продуктах минимальный необходимый уровень	
систему мониторинга качества инвестиционного портфеля клиента (селекция и аллокация активов) в контексте расчета величины портфеля, достаточной для покрытия финансовых целей; размера инвестиций; целевой доходности минимальный необходимый уровень	
основы финансового планирования	
теоретические основы финансового анализа	
инструменты управления активами и финансовыми продуктами	
общие положения стресс-тестирования и сценарного анализа	
теоретические основы финансового планирования и критерии мониторинга его выполнения	
этапы и принципы формирования инвестиционного портфеля клиента	
общие положения о денежном потоке	
<b>3.2</b>	<b>Уметь:</b>
составлять и согласовывать инвестиционный портфель клиента, определять и согласовывать правила информирования клиента и критерии взаимодействия с клиентом; презентовать согласованные финансовые решения клиенту минимальный необходимый уровень	
выявлять качественные и количественные свойства рисков; составлять перечень рекомендаций по управлению инвестиционным риском в предполагаемых к использованию финансовых продуктах минимальный необходимый уровень	
проводить мониторинг качества инвестиционного портфеля клиента (селекция и аллокация активов) в контексте расчета величины портфеля, достаточной для покрытия финансовых целей; размера инвестиций; целевой доходности минимальный необходимый уровень	
инициировать привлечение независимых внешних консультантов и экспертов в области финансовых рынков	
анализировать финансовое положение клиента	
применять инструментарий управления активами и финансовыми продуктами	
проводить стресс-тесты и сценарный анализ	
формировать финансовый план и критерии мониторинга его выполнения	
формировать инвестиционный портфель клиента	
составлять прогноз денежного потока	
<b>3.3</b>	<b>Владеть:</b>
методикой составления и технологией согласования в сфере инвестирования и формирования инвестиционного портфеля клиента	
методикой выявления качественные и количественные свойства рисков; способностью составлять перечень рекомендаций по управлению инвестиционным риском в предполагаемых к использованию финансовых продуктах минимальный необходимый уровень	
методами разработки мониторинга проводить мониторинг качества инвестиционного портфеля клиента (селекция и аллокация активов) в контексте расчета величины портфеля, достаточной для покрытия финансовых целей; размера инвестиций; целевой доходности минимальный необходимый уровень	
методами решения задач финансового планирования	
способностью анализировать финансовое положение клиента	
способностью применять инструментарий управления активами и финансовыми продуктами	
технологией стресс-тестирования и методами сценарного анализа	
методами финансового планирования и способами выбора критериев мониторинга его выполнения	
методикой формирования инвестиционного портфеля клиента	
методикой составления прогноза денежного потока	