

Документ подписан простой электронной подписью

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

ФИО: Агабекян Раиса Левоновна

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

Дата подписания: 30.05.2023 16:35:35

(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 **заочная**

Программу составил(и): дэн, доцент, Головки М.В.

Распределение часов дисциплины по курсам

Курс Вид занятий	1		2		Итого	
	уп	рп	уп	рп		
Лекции	2	2	4	4	6	6
Практические			8	8	8	8
Контактная работа на аттестации (в период экз. сессий)			0,2	0,2	0,2	0,2
В том числе инт.			8	8	8	8
В том числе в форме практ.подготовки			2	2	2	2
Итого ауд.	2	2	12	12	14	14
Контактная работа	2	2	12,2	12,2	14,2	14,2
Сам. работа	34	34	56	56	90	90
Часы на контроль			3,8	3,8	3,8	3,8
Итого	36	36	72	72	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
2.1	Требования к предварительной подготовке обучающегося:	
2.1.1	Производные и финансовые инструменты	
2.1.2	Портфельные теории и управление активами	
2.1.3	Учебная практика: научно-исследовательская работа	
2.2	Дисциплины и практики, для которых освоение данной дисциплины (модуля) необходимо как предшествующее:	
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 разработать и обосновать финансово – экономические показатели, характеризующие деятельность коммерческих и некоммерческих организаций различных организационно – правовых форм, включая финансово – кредитных органов государственной власти и местного самоуправления

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

Знать:
основы финансового планирования
теоретические основы организации экспертизы
общие положения по привлечению независимых внешних консультантов и экспертов в области финансовых рынков для решения задач финансового планирования
Уметь:
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
Владеть:
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

ПК-3.5: Анализирует финансовое положение клиента на предмет выявления несоответствия текущего финансового состояния клиента его финансовым целям

Знать:
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
Уметь:
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
Владеть:
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

ПК-3.6: Подбирает классы активов и финансовых продуктов в соответствии с потребностями клиента

Знать:
инструменты управления активами и финансовыми продуктами
потребности клиента
инструменты управления активами и финансовыми продуктами в соответствии с потребностями клиента
Уметь:
применять инструментарий управления активами и финансовыми продуктами
выявлять потребности клиента
подбирать классы активов и финансовых продуктов в соответствии с потребностями клиента
Владеть:
способностью применять инструментарий управления активами и финансовыми продуктами
способностью выявлять потребности клиента
способностью подбирать классы активов и финансовых продуктов в соответствии с потребностями клиента

ПК-3.7: Проводит стресс-тесты и сценарный анализ, по результатам которого моделирует целевой портфель клиента

Знать:
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
Уметь:
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
Владеть:
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
Знать:
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
Уметь:
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
Владеть:
методами финансового планирования и способами выбора критериев 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
Знать:
этапы и принципы формирования инвестиционного портфеля клиента
основы оценки эффективности инвестиционного портфеля клиента
основные положения о доходности и риску инвестиционного портфеля клиента
Уметь:
формировать инвестиционный портфель клиента
выбирать активы инвестиционного портфеля клиента
определять стоимость капитала инвестиционного портфеля клиента
Владеть:
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)
Знать:
общие положения о денежном потоке
общие положения о заемных средствах
особенности прогнозирования денежного потока
Уметь:
составлять прогноз денежного потока
анализировать использование заемных средств
составлять прогноз денежного потока и анализировать использование заемных средств (кредитных продуктов)
Владеть:
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

3.1	Знать:
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	
3.2	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	
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	
3.3	Владеть:
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	