

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	<b>Кафедра бизнес-процессов и экономической безопасности</b>
Учебный план	38.04.08 Финансы и кредит
Квалификация	<b>магистр</b>
Форма обучения	<b>заочная</b>
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 на 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)

<b>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</b>	
<b>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</b>	
<b>Знать:</b>	
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	
<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	
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	
<b>Владеть:</b>	
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	



<b>Знать:</b>
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
<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

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

<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

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

<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

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

<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

<b>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>
<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

<b>ПК-3.9: Анализирует, пересматривает (ребалансирует) состав активов, изменения стоимости капитала инвестиционного портфеля клиента</b>
<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

<b>ПК-3.10: Составляет прогноз денежного потока, с детальным анализом использования заемных средств (кредитные продукты)</b>
<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	