

**Федеральное государственное образовательное бюджетное
учреждение высшего образования
«ФИНАНСОВЫЙ УНИВЕРСИТЕТ
ПРИ ПРАВИТЕЛЬСТВЕ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ»**

(Финансовый университет)

Департамент «Финансовые рынки и банки»

СОГЛАСОВАНО


Президент Национальной финансовой
ассоциации


К.А. Волков
«26» декабря 2016 г.



УТВЕРЖДАЮ

Ректор


М.А. Эскиндаров
«29» декабря 2016 г.

**Магистерская программа «Финансовая математика и
анализ рынков»**

Направление 38.04.08 «Финансы и кредит»

Руководитель образовательной программы: Миркин Я.М., д.э.н., профессор
Департамента финансовых рынков и банков

Выпускающий департамент: Департамент финансовых рынков и банков

Факультет: Кредитно-экономический факультет

Москва 2016

Направление 38.04.08 «Финансы и кредит»

Магистерская программа

«Финансовая математика и анализ рынков»

Образовательная программа по направлению подготовки 38.04.08 «Финансы и кредит», магистерская программа «Финансовая математика и анализ рынков» (уровень магистратуры) является программой нового поколения и разработана на основе федерального государственного образовательного стандарта высшего образования по направлению подготовки 38.04.08 «Финансы и кредит» (ФГОС+ЗВО) (ФГОС ВО 3+ утвержден приказом Минобрнауки России от 30.03.2015 № 325).

Программа разработана в соответствии с профессиональным стандартом «Специалист рынка ценных бумаг» (приказ Минтруда России от 23.03.2015 № 184н. Зарегистрировано в Минюсте России 03.04.2015 № 36712) и «Специалист по финансовому консультированию» (Приказ Минтруда России от 19.03.2015г. №167н. Зарегистрировано в Минюсте РФ 09.04.2015г., регистрационный №36805).

Основными видами профессиональной деятельности являются: аналитическая, проектно-экономическая, организационно-управленческая, консалтинговая, научно-исследовательская, педагогическая.

Образовательная программа направлена на подготовку специалистов по разработке стратегии управления портфелем финансовых активов, торговле на фондовом и срочном рынке с использованием современных математических моделей и методов технического и фундаментального анализа, оценке и управлению рисками, конструированию новых финансовых продуктов с использованием производных финансовых инструментов в банках, страховых, инвестиционных и управляющих компаниях, пенсионных фондах.

Программа ориентирована на студентов, имеющих хорошую математическую подготовку (выпускников технических или экономических

вузов), желающих получить квалификацию магистра экономики со специализацией в области финансовых рынков и/или работающих в финансовом секторе.

Важная роль в образовательной программе отводится формированию дополнительных компетенциях магистерской программы, помогающих выпускникам Финансового университета успешно конкурировать на рынке труда:

способности осуществлять разработку теоретических и новых экономических моделей исследуемых процессов, явлений и объектов, относящихся к сфере профессиональной финансовой деятельности в области финансов и кредита, давать оценку и интерпретировать полученные в ходе исследования результаты, способности выявлять и проводить исследование финансово-экономических рисков в деятельности хозяйствующих субъектов для разработки системы управления рисками (ДКМП-1);

способности проводить исследование проблем финансовой устойчивости организаций, в том числе финансово-кредитных, для разработки эффективных методов обеспечения их функционирования с учетом фактора неопределенности (ДКМП-2);

способности применять теорию стохастических процессов для анализа и прогнозирования финансовых рынков (ДКМП-3);

способности применять современные алгоритмы и методы для создания математических моделей функционирования финансовых рынков (ДКМП-4).

Наиболее востребованными эти компетенции окажутся в компаниях финансовой сферы и области управления рисками, разработки новых продуктов, исследовательских и аналитических подразделениях, казначействе.

Магистерская программа реализуется совместно с департаментом «Анализ данных, принятия решений и финансовых технологий», что дает возможность подготовки разностороннего специалиста, в то же время, владеющего специфическими навыками и умеющего решать конкретные прикладные задачи в выбранной области с использованием современных методов математического моделирования и вычислительной техники.

Индивидуальность обучения достигается возможностью выбора конкретных прикладных дисциплин для включения в образовательную траекторию, участием в работе научно-исследовательского семинара на протяжении всего обучения по индивидуальному направлению, выбором темы магистерской диссертации уже на первом курсе.

Привлечение практических специалистов к проведению занятий позволяет формировать прикладные навыки студента, четко определять проблемную область исследования и быть в курсе современных процессов на финансовом рынке. Партнерами программы являются ИК «Еврофинансы», банк «ВТБ», ГК «АЛОР».

Руководитель образовательной программы – Миркин Яков Моисеевич, д.э.н., профессор департамента финансовых рынков и банков, председатель совета директоров ИК «Еврофинансы».

Образовательный процесс осуществляется на Кредитно-экономическом факультете. Выпускающий департамент – «Финансовые рынки и банки» (рук. департамента – д.э.н., профессор О.И.Лаврушин).

Среди преподавателей программы доля кандидатов и докторов наук составляет 95%.

В реализации программы участвуют следующие представители научных школ и авторы учебников:

Миркин Яков Моисеевич, д.э.н., профессор, основатель научной школы «Ценные бумаги и финансовый инжиниринг», Автор учебника «Ценные бумаги и фондовый рынок (М.: 1995), Монографии «Рынок ценных бумаг России: воздействие фундаментальных факторов, прогноз и политика развития» (М.:2002), Финансовое бедующее России: экстремумы, бумы, системные риски»(М.:2011), «Финансовый конструктивизм» (М.: 2014): создатель уникального научно-образовательного сайта миркин.ру; Председатель Совета директоров ИК «Еврофинансы».

Рубцов Борис Борисович, д.э.н. профессор, руководитель научной школы «Ценные бумаги и финансовый инжиниринг», автор учебников «Зарубежные фондовые рынки» (М.: 1996), «Современные фондовые рынки» (М.,2007); автор и соавтор 15 монографий по проблемам экономики и финансов.

В реализации программы также принимают участие ведущие преподаватели департамента «Анализ данных, принятия решений и финансовых технологий» - специалисты в области стохастической финансовой математики и математической теории рисков.

Студенты проходят практику на Московской бирже, в Банке России, коммерческих банках, инвестиционных компаниях (в частности, «Еврофинансы», «Финам» «Алор»), саморегулируемых организациях (НФА, НАУФОР, АУВЕР).

Выпускники магистерской программы «Финансовая математика и анализ рынков» работают в инвестиционных компаниях, банках, на предприятиях реального сектора, в государственных регулятивных органах (Банке России, Министерстве финансов) аналитиками, управляющими портфелями ценных бумаг, трейдерами, риск-менеджерами, разработчиками программ финансирования компании, специалистами по корпоративным финансам (в т.ч. по слияниям и поглощениям), специалистами по разработке новых финансовых продуктов.