

RTU studiju kurss "Finanšu ekonometrija"**22000 Inženierekonomikas un vadības fakultāte****Vispārējā informācija**

Kods	IĀS303
Nosaukums	Finanšu ekonometrija
Studiju kursa statuss programmā	Obligātais/Ierobežotās izvēles
Atbildīgais mācītspēks	Remigij Počs - Habilitētais doktors, Profesors Viesis
Mācītspēks	Māris Buiķis - Doktors, Vecākais pasniedzējs
Apjoms daļās un kredītpunktos	1 daļa, 6.0 kredītpunkti
Studiju kursa īstenošanas valodas	LV
Anotācija	Finanšu rādītāju laika rindu raksturojums, autoregresijas modeļi. Sezonālītātes analīze. Akciju tirgus nenoteiktība: autoregresija vispārējā un nosacījuma heteroskedastitāte, lietojot ARCH un GARCH modeļus. Parametru novērtēšanas metodes (maksimālās līdzības metode, nelineārā optimizācija). Datu reģistrācijas problēmas. Rezultātu interpretācija. Finanšu rādītāju analīze un prognozēšana, izmantojot programmu paketi EVIEWS.
Mērķis un uzdevumi, izteikti kompetencēs un prasmēs	Apgūt svarīgākās ekonometrijas metodes un datorprogrammas un to lietošanu finanšu rādītāju un procesu analīzē. Uzdevumi: attīstīt studējošo kompetences un prasmes, apkopojot un vērtējot statistisko informāciju par finanšu rādītājiem, to dinamiku, struktūru un ietekmējošajiem faktoriem. Prast lietot ekonometriskās datu apstrādes metodes un veidot finanšu rādītāju ekonometriskos modeļus.
Patstāvīgais darbs, tā organizācija un uzdevumi	Izmantojot datorprogrammu "EViews" risināt uzdevumus praktisko nodarbību laikā un ārpus kontaktstundu laika, analizējot un pamatojot iegūtos rezultātus.
Literatūra	1. Campbell, J.Y., A.W. LO, and A.C. Mackinlay. The Econometrics of Financial Markets. Princeton University Press. 1997. 2. Alexander, C. Market Models: A Guide to Financial Data Analysis. Wiley, Chichester, UK. 2001. 3. Cuthbertson, K. Quantitative Financial Economics. Wiley, Chichester. 1996. 4. Peijie, W. Financial Econometrics: Methods and Models. 2002. 5. Revina, I. Ekonometrija. Mācību grāmata. LU, Rīga, 2002.
Nepieciešamās priekšzināšanas	DMS316 .Finansu matemātika un statistika

Studiju kursa saturs

Saturs	Pilna un nepilna laika klātienes studijas		Nepilna laika neklātienes studijas	
	Kontakt stundas	Patstāv. darbs	Kontakt stundas	Patstāv. darbs
Ekonometrisko modeļu veidi (matemātiskās formas, mainīgie lielumi, parametri u.c.),	4	0	0	0
Ekonometrijas datorprogramma EVIEWS - vispārējs raksturojums	4	0	0	0
Operācijas ar datorprogrammu EVIEWS (sēriju ievads, datu ģenerēšana u.c.)	4	0	0	0
Datu sagatavošana finanšu ekonometriskajiem modeļiem.	4	0	0	0
Finanšu sakarību pētīšanas uzdevumi ekonometrijā (daudzfaktoru, nelineāro, dinamisko, autoregresijas u.c. modeļu veidošana)	8	0	0	0
Faktoru izvēle un pamatošana finanšu ekonometriskajos modeļos	4	0	0	0
Parametru novērtēšanas metodes	8	0	0	0
Ekonometrisko modeļu statistiskās nozīmības noteikšana un pārbaude, gadījuma komponentes analīze	8	0	0	0
Savstarpēji saistītu ekonometrisku vienādojumu sistēmas	8	0	0	0
Finanšu rādītāju prognožu izstrāde, izmantojot ekonometriskos modeļus	8	0	0	0
Ekonometrisko modeļu pielietošana praksē (Latvijas finanšu tirgus modeļa piemērs)	4	0	0	0
Kopā:	64	0	0	0

Sasniedzamie studiju rezultāti un to vērtēšana

Sasniedzamie studiju rezultāti	Rezultātu vērtēšanas metodes
Prot izmantot ekonometrisku datorprogrammu "EViews" statistisko datu apstrādē un analīzē	Kontroldarbs
Spēj konstruēt dažāda tipa finanšu rādītāju ekonometriskā tipa modeļus, vērtēt to parametrus un statistisko nozīmību	Kontroldarbs, eksāmens
Spēj analizēt ekonometriskos finanšu modeļus, pielietojot tos finanšu rādītāju dinamikas analīzē un prognozēšanā	Kontroldarbs, eksāmens

Studiju kursa plānojums

Daļa	KP	Stundas			Pārbaudījumi		
		Lekcijas	Prakt d.	Laborat	Ieskaite	Eksām.	Darbs

1.	6.0	2.0	2.0	0.0		*	
----	-----	-----	-----	-----	--	---	--