

RTU studiju kurss "Inovatīvie finanšu instrumenti"

22000 Inženierekonomikas un vadības fakultāte

Vispārējā informācija

Kods	IĀS504
Nosaukums	Inovatīvie finanšu instrumenti
Studiju kursa statuss programmā	Obligātais/Ierobežotās izvēles
Atbildīgais mācītbspēks	Konstantīns Kozlovskis - Doktors, Asociētais profesors
Apjoms daļās un kredītpunktos	1 daļa, 6.0 kredītpunkti
Studiju kursa īstenošanas valodas	LV
Anotācija	Inovatīvo (atvasināto) finanšu instrumentu būtība un veidi. Forvarda un fjučera līgumi, to izmantošana. Opciju kontrakti, opciju stratēģijas. Opciju prēmijas noteikšanas principi. Bleka - Šoulsa formula. Procentu likmju un valūtas SWAP kontrakti. Finanšu risku vadīšana, izmantojot dažādu līgumu formas.
Mērķis un uzdevumi, izteikti kompetencēs un prasmēs	Priekšmeta uzdevums ir dot studentiem zināšanas par finanšu inovāciju veidošanu un pielietojumu un ar to saistītajiem riskiem, kā arī parādīt dažādas finanšu pārvaldības iespējas, izmantojot inovatīvus finanšu instrumentus un risinājumus. Studiju priekšmeta apguve studentiem attīstīs kompetences: veidot izpratni par finanšu inovāciju būtību; novērtēt un pielietot dažādus finanšu inženierijas risinājumus, analizēt, salīdzināt un izmantot finanšu instrumentus risku samazināšanai; apkopot zināšanas par teorijām un praktiskajām metodēm, kas saistītas ar inovatīvas vides radīšanu organizācijā; prast klasificēt iespējamus risinājumus, finanšu instrumentus un lēmumu pieņemšanu ietekmējošos faktoros.
Patstāvīgais darbs, tā organizācija un uzdevumi	Studenti apgūst teorētiskās zināšanas un praktiskās iemaņas arī patstāvīgi, sagatavoties diskusijām atbilstoši piedāvātiem jautājumiem, risinot praktiskos uzdevumus, strādājot individuāli un grupā.
Literatūra	1.E. Elton, M.Gruber. Modern Portfolio and Investment Analysis. John Wiley & Sons Inc. 1995. 2.A. Adams, D. Bloomfield, F. Booth, P. England. Investment mathematics and statistics. London, Dordrecht, Boston: Graham & Trotman, 1993, p.410. 3.L.R likums "Par akcijām sabiedrībām". - Ziņotājs, 1993, Nr. 24-25., grozījumi un papildinājumi - Ziņotājs, 1994, Nr. 3. 4.M. Krogzeme. Investīciju projektu novērtēšana. TU, Rīga 1996. 5.Financial Engineering principles: a unified theory for financial product analysis and valuation / Perry H. Beaumont (Wiley finance series) – 293 p. 6.Metric, A., Venture Capital and the Finance of Innovation, 2006.
Nepieciešamās priekšzināšanas	Priekšmets balstās uz zināšanām, kas iegūtas studējot sociālo zinātņu bakalaura ekonomikas vai vadīzinātnes studiju programmās. Iepriekš apgūstamie priekšmeti maģistra studijās: „Ekonomikas teorija”, „Finanšu tirgi un investīcijas”.

Studiju kursa saturs

Saturs	Pilna un nepilna laika klātienes studijas		Nepilna laika neklātienes studijas	
	Kontakt stundas	Patstāv. darbs	Kontakt stundas	Patstāv. darbs
Ievads: Finanšu inovācijas būtība un veidi	2	0	0	0
Finanšu tirgu globalizācija, tās ietekme uz jaunattīstības tirgiem	4	0	0	0
Finanšu inovācija un institūcijas	8	0	0	0
Finanšu inovācijas un finanšu matemātika. Pamatprincipi. Aprēķini un modeļi	10	0	0	0
Naudas plūsma, finanšu inovācijas iespējas naudas plūsmas optimizēšanā	6	0	0	0
Procentu likmes un to atvasinātie finanšu instrumenti	2	0	0	0
Mijapmaiņas (Swap) līgumi	2	0	0	0
REPO darījumi. Būtība un stratēģija	2	0	0	0
Opciju darījumi	4	0	0	0
Kredītu derivatīvi	2	0	0	0
Hipotekārie vērtspapīri un inovācija	4	0	0	0
Riska kapitāls	10	0	0	0
Kapitālsabiedrību reorganizācija	8	0	0	0
Kopā:	64	0	0	0

Sasniedzamie studiju rezultāti un to vērtēšana

Sasniedzamie studiju rezultāti	Rezultātu vērtēšanas metodes
Spēj nodemonstrēt izpratni par finanšu inovāciju būtību.	Sagatavoties diskusijai atbilstoši piedāvātiem jautājumiem. Praktiskie darbi nodarbībās.

Spēj novērtēt un pielietot dažādus finanšu inženierijas risinājumus, analizēt, salīdzināt un izmantot finanšu instrumentus risku samazināšanai.	Individuālie vai grupas projekti. Iegūto rezultātu prezentēšana nodarbībā. Pasniedzējs analizē un vērtē rezultātus lekcijas laikā, sniedz komentārus.
Spēj apkopot zināšanas par teorijām un praktiskajām metodēm, kas saistītas ar inovatīvas vides radīšanu organizācijā.	Situācijas (case study) analīze. Individuālie vai grupas projekti. Iegūto rezultātu prezentēšana nodarbībā. Pasniedzējs analizē un vērtē rezultātus lekcijas laikā, sniedz komentārus.
Spēj klasificēt iespējamus risinājumus, finanšu instrumentus un lēmumu pieņemšanu ietekmējošos faktorus.	Individuālie vai grupas projekti. Iegūto rezultātu prezentēšana nodarbībā. Pasniedzējs analizē un vērtē rezultātus lekcijas laikā, sniedz komentārus.
Eksāmens.	Eksāmena rezultāts veido 50% no kopējā novērtējuma; piedalīšanās diskusijās nodarbību laikā veido 10% no kopējā novērtējuma; Individuālie vai grupas projekti - 40%.

Studiju kursa plānojums

Daļa	KP	Stundas			Pārbaudījumi		
		Lekcijas	Prakt d.	Laborat	Ieskaite	Eksām.	Darbs
1.	6.0	2.0	2.0	0.0		*	