

RTU studiju kurss "Ievads vērtspapīru portfeļa analizē"

22000 Inženierekonomikas un vadības fakultāte

Vispārējā informācija

Kods	IĀS304
Nosaukums	Ievads vērtspapīru portfeļa analizē
Studiju kursa statuss programmā	Obligātais/Ierobežotās izvēles
Atbildīgais mācībspēks	Remigijs Počs - Habilitētais doktors, Profesors
Mācībspēks	Māris Buiķis - Doktors, Docētājs
Apjoms daļās un kredītpunktos	1 daļa, 4.5 kredītpunkti
Studiju kursa īstenošanas valodas	LV
Anotācija	Šajā priekšmetā tiek aplūkoti tradicionāli un mūsdienīgi vērtspapīru analīzes veidi, vērtspapīru novērtēšanas koncepcijas teorētiskie aspekti, kā arī tradicionāla un mūsdienīga portfeļa vadīšanas metodoloģija.
Mērķis un uzdevumi, izteikti kompetencēs un prasmēs	Apgūt zināšanas vērtspapīru portfeļa veidošanas teorijā un praktiskā pielietojumā. Uzdevumi: Apgūt vērtspapīru portfeļa veidošanas principus, veidot optimālu vērtspapīru portfeļa struktūru, analizēt tā dinamiku, pieņemt efektīvus lēmumus investīciju resursu izmantošanā
Patstāvīgais darbs, tā organizācija un uzdevumi	Izmantojot statistisko informāciju un apgūto teoriju, risināt uzdevumus praktisko nodarbību laikā, analizējot un pamatojot iegūtos rezultātus
Literatūra	1. G.Apsītis u.c. Vērtspapīru tirgus zinības. Rīgas Fondu firža. Jumava, 2003. - 212 lpp. 2. Investment Analysis and Portfolio Management / Frank K.Reilly, Keith C. Brown, 7 ed., 2002 3. Investment Management. Securities and Portfolio Management/ B.Hiriyappa. - New Age International. -2008, 235 p.
Nepieciešamās priekšzināšanas	IET102 .Mikroekonomika

Studiju kursa saturs

Saturs	Pilna un nepilna laika klātienes studijas		Nepilna laika neklātienes studijas	
	Kontakt stundas	Patstāv. darbs	Kontakt stundas	Patstāv. darbs
Portfeļu teorijas attīstības posmi.	4	0	0	0
Mūsdienīga portfeļu teorija: sastāvelementi, diversifikācijas būtība, priekšrocības un trūkumi	10	0	0	0
Akcijas: gaidāmā riska un ienesīguma novērtēšana, portfeļu veidošana un vadīšana	10	0	0	0
Obligācijas: ilgums, modificētais ilgums, imūnizācija	10	0	0	0
Ārpusbiržas nākotnes līgumi: novērtēšana un portfeļu veidošana	8	0	0	0
Daudzaktīvu portfeļu vadīšana	6	0	0	0
Kopā:	48	0	0	0

Sasniedzamie studiju rezultāti un to vērtēšana

Sasniedzamie studiju rezultāti	Rezultātu vērtēšanas metodes
Pārzin vērtspapīru portfeļa veidošanas vispārīgos principus	Kontroldarbs
Prot izvēlēties un pamatot vērtspapīru portfeļa struktūru	Kontroldarbs
Spēj vērtēt un analizēt vērtspapīru portfeļa ienesīgumu, dinamiku	Kontroldarbs, ieskaite
Prot veidot kapitāla aktīvu tirgus modeļus	Kontroldarbs, ieskaite

Studiju kursa plānojums

Daļa	KP	Stundas			Pārbaudījumi		
		Lekcijas	Prakt d.	Laborat	Ieskaite	Eksām.	Darbs
1.	4.5	2.0	1.0	0.0		*	