

RTU studiju kurss "Investīciju vadība"

01B00 Rīgas Biznesa skola

Vispārējā informācija

Kods	PBM736
Nosaukums	Investīciju vadība
Studiju kursa statuss programmā	Brīvās izvēles
Atbildīgais mācītbspēks	Raimonds Lieksnis - Doktors, Docents
Apjoms daļās un kredītpunktos	1 daļa, 4.0 kredītpunkti, 6.0 EKPS kredītpunkti
Studiju kursa īstenošanas valodas	EN
Anotācija	Studiju kurss izveidots, lai palīdzētu studentiem apgūt zināšanas par mūsdienu investīciju teoriju un vienlaikus attīstīt prasmes, lai varētu izveidot un īstenot investīciju stratēģiju. Studiju kurss ir orientēts uz otrreizējo tirgu, vērtspapīriem un atvasinātajiem instrumentiem, portfeļa pārvaldību, vērtspapīru analīzi un vērtēšanu. Studiju kursā tiek pētīti finanšu tirgi, galvenokārt akciju tirgi, no investīciju lēmumu pieņemšanas viedokļa. Studiju kursā tiek izstrādāts konceptuālo ietvaru un analītisko rīku kopums un pēc tam tie tiek piemēroti konkrētiem ieguldījumiem un ieguldījumu stratēģijām, kas izvēlētas no plaša uzņēmumu, vērtspapīru un institucionālo kontekstu klāsta. Galvenā uzmanība tiek pievērsta pievienotās vērtības radīšanai visā lēmumu spektrā, sākot no pozīcijas noteikšanas atsevišķos vērtspapīros, līdz portfeļa riska pārvaldībai un profesionālu ieguldījumu pārvaldnieku deleģēšanai un uzraudzībai dažādās ekonomiskajās vidēs. Studiju kursā tiek pētīta konkurences dinamika starp ieguldījumu organizācijām, produktiem un tirgiem. Studiju kurss sniedz visaptverošu ievadu finanšu pakalpojumu nozarē, īpašu uzmanību pievēršot investīcijām globālā skatījumā.
Mērķis un uzdevumi, izteikti kompetencēs un prasmēs	Studiju kursa mērķis ir sagatavot studentus 'Chartered Institute for Securities & Investment (CISI) eksāmeņiem. Studiju kursa uzdevumi ir: - iepazīstināt studentus ar Latvijas finanšu tirgu; - pilnveidot prasmi pārvaldīt finanses; - iepazīstināt ar mūsdienu investīciju teoriju; - attīstīt prasmi īstenot investīciju stratēģijas.
Patstāvīgais darbs, tā organizācija un uzdevumi	Studenti uz nodarbību ieradīsies gatavi piedalīties klases diskusijās/prezentācijās. Tas nozīmē, ka ir izpildīti uzdevumi, analizēti gadījumi utt. Papildu lasāmvielai studenti būs atbildīgi par vairāku pētniecisko darbu izpildi, kas saistīti ar pasaules finanšu pakalpojumu nozari un investīciju tendencēm. Daži no šiem uzdevumiem tiks prezentēti semināru laikā, un tie visi tiks novērtēti.
Literatūra	Obligātā/Obligatory: Investments, Global Edition, 10th Edition, by Zvi Bodie, Alex Kane, Alan Marcus, Published by McGraw-Hill Education (UK) Ltd, 2013, 1080 p. Investment Valuation - Tools and Techniques for Determining the Value of Any Asset, Third Edition, by Aswath Damodaran. 2012. (available in ORTUS Dawsonera database), 2012, 992 p. Investment Analysis and Portfolio Management 10th Edition Frank K. Reilly, Keith C. Brown, 2011, 1080 p.
Nepieciešamās priekšzināšanas	Priekšzināšanas nav nepieciešamas.

Studiju kursa saturs

Saturs	Pilna un nepilna laika klātienē studijas		Nepilna laika neklātienē studijas	
	Kontakt stundas	Patstāv. darbs	Kontakt stundas	Patstāv. darbs
Investīciju vide.	5	4	0	0
Vērtspapīru tirdzniecība.	5	4	0	0
Kapitāla piešķiršana riskantiem aktīviem.	5	4	0	0
Optimāli riskanti portfeļi.	2	5	0	0
Investīciju politika un ietvars.	6	4	0	0
Vērtspapīru novērtēšana.	3	4	0	0
Drošības analīze: finanšu pārskata analīze.	5	4	0	0
Kapitāla novērtēšanas modeļi I.	5	4	0	0
Kapitāla novērtēšanas modeļi II.	2	5	0	0
Uzvedības finanses un tehniskā analīze.	5	4	0	0
Drošības fondi.	2	4	0	0
Iespējas un nākotne: Ievads.	5	5	0	0
Iespējas novērtēšana.	5	4	0	0
Nākotnes darījumu tirgi, mijmaiņas darījumi un riska pārvaldība.	5	4	0	0
Fiksēta ienākuma vērtspapīri: Obligāciju cenas un ienesīgums.	5	4	0	0
Fiksēta ienākuma vērtspapīri: Procentu likmju termiņstruktūra.	5	4	0	0
Obligāciju portfeļa pārvaldīšana.	3	4	0	0

APT un daudzfaktoru modeļi.	3	5	0	0
Efektīva tirgus hipotēze.	4	4	0	0
Kopā:	80	80	0	0

Sasniedzamie studiju rezultāti un to vērtēšana

Sasniedzamie studiju rezultāti	Rezultātu vērtēšanas metodes
Spēj izskaidrot kapitāla tirgus darbību.	Aktivitāte lekcijās, starpeksāmens, gala eksāmens.
Spēj izmantot investīciju vadības analītiskos rīkus.	Aktivitāte lekcijās, starpeksāmens, gala eksāmens.
Prot izmantot dažādus finanšu instrumentus portfeļu veidošanai.	Aktivitāte lekcijās, starpeksāmens, gala eksāmens.
Prot pielietot zināšanas un prasmes, lai analizētu uzņēmumus ieguldījumu mērķiem.	Aktivitāte lekcijās, starpeksāmens, gala eksāmens.
Spēj ētiski darboties kā investīciju pārvaldības profesionāļi.	Aktivitāte lekcijās, starpeksāmens, gala eksāmens.

Studiju rezultātu vērtēšanas kritēriji

Kritērijs	% no kopējā vērtējuma
Aktivitāte lekcijās	30
Starpeksāmens	20
Gala eksāmens	50
Kopā:	100

Studiju kursa plānojums

Daļa	KP	Stundas			Pārbaudījumi			Brīvās izvēles pārbaudījumi		
		Lekcijas	Prakt d.	Laborat	Ieskaite	Eksām.	Darbs	Ieskaite	Eksām.	Darbs
1.	4.0	2.0	2.0	0.0		*				