

RTU studiju kurss "Finanšu risku vadība"

22000 Inženierekonomikas un vadības fakultāte

Vispārējā informācija

Kods	IV0082
Nosaukums	Finanšu risku vadība
Studiju kursa statuss programmā	Obligātais/Ierobežotās izvēles
Atbildīgais mācībspēks	Natalja Lāce - Doktors, Profesors
Mācībspēks	Tālis Laizāns - Docents (praktiskais)
Apjoms daļās un kredītpunktos	1 daļa, 5.0 kredītpunkti
Studiju kursa īstenošanas valodas	LV
Anotācija	Ievads riska un katastrofu teorijās. Tiek aplūkoti riska pamatjēdzieni, risku klasifikācija, finanšu riska jēdziens un tā klasifikācija. Detalizēti aplūkoti risku identifikācija, novērtēšana, risku vadības metodes un riska vadīšanas stratēģijas veidi, ka arī finansēšana. Aplūkoti finanšu risku novērtējuma testu sistēma. Īpaša uzmanība tiek veltīta dažādu varbūtību sadalījumu modelēšana ar Monte-Karlo metodi, kļūdu novērtējumam, hipotēžu pārbaudei. Individuālie un kolektīvie riska modeļi un to modelēšana ar Monte-Karlo metodi.
Mērķis un uzdevumi, izteikti kompetencēs un prasmēs	Kursa mērķis ir iepazīstināt ar finanšu risku vadīšanas metodēm, finanšu un ne finanšu uzņēmumos un apgūt lēmumu pieņemšanas metodiku dažāda līmeņa nenoteiktības apstākļos. Dot priekšstatu par risku vadīšanas programmu. Uzdevumi: Izprast riska pamatjēdzienus, riska klasifikāciju; Prast lietot risku identifikācijas un novērtēšanas metodes; Iepazīties ar finanšu un vadības informācijas analīzes metodikas īpatnībām; Izprast finanšu risku vērtēšanas kartību un riska samazināšanas pasākumu būtību; Prast motivēt risku vadības programmu izstrādāšanas nepieciešamību; Prast izstrādāt un pielietot risku vadības programmu ražošanas uzņēmumā.
Patstāvīgais darbs, tā organizācija un uzdevumi	1. Finanšu risku noteikšana, izmantojot kompleksos rādītājus (D. Djurana metodika, Bivera modelis). Uzdevumi. 2. Statistiskās riska novērtēšanas metodes: Monte Karlo metode, Value at Risk. Ekstremālas vērtības teorija. Situācijas analīze Uzdevumi. 3. Riska elements lēmuma teorijā. Jūtīguma analīze. Beiesa analīze. Derīguma funkcijas. Uzdevumi. Situācijas analīze.
Literatūra	1. Kudinska, M. Komerbanku riski un to atbilstība pašu kapitālam. – Rīga: Datorzinību centrs, 2005. – 293 lpp. 2. Pettere, G., Voronova, I. Riski uzņēmējdarbībā un to vadība. - Rīga: Banku augstskola, 2004. - 176 lpp. 3. Jansons, V. Gadījuma lielumu modelēšana. Elektroniskā veidā. - RTU IEF. 2002. 4. Jansons, V. Risku teorija piemēros. Elektroniskā veidā. - RTU IEF. 2002. 5. Jaunzems, A. Risku analīze un vadīšana. - Ventspils: Ventspils Augstskola, 2009.- 361 lpp. 6. Четыркин, Е.М. Финансовые риски. – Москва: Дело, 2008. – 175 с.
Nepieciešamās priekšzināšanas	Priekšmets balstās uz zināšanām, kas iegūtas augstākās izglītības iepriekšējā līmenī, piemēram, ekonomiskajā statistikā, varbūtības teorijā, uzņēmējdarbības ekonomikā.

Studiju kursa saturs

Saturs	Pilna un nepilna laika klātienēs studijas		Nepilna laika neklātienēs studijas	
	Kontakt stundas	Patstāv. darbs	Kontakt stundas	Patstāv. darbs
1. Riska būtība un tā klasifikācija.	4	0	0	0
2. Risku noteikšanas metodes nefinanšu uzņēmumos.	10	0	0	0
3. Finanšu risku novērtēšana. Finanšu risku vadībā finanšu uzņēmējdarbības sektorā.	21	0	0	0
4. Uzņēmējdarbības lēmumu pieņemšanas kritēriji nenoteiktības apstākļos.	10	0	0	0
5. Risku vadības metodoloģija.	3	0	0	0
Kopā:	48	0	0	0

Sasniedzamie studiju rezultāti un to vērtēšana

Sasniedzamie studiju rezultāti	Rezultātu vērtēšanas metodes
Spēj lietot risku identifikācijas metodes un izmantot novērtēšanas metodes.	Atrisināt 5-10 praktiskus uzdevumus. Kontroldarbs. Vērtēšana pēc 10 baļļu sistēmas.
Izprot finanšu risku vērtēšanas kartību un riska samazināšanas pasākumu būtību.	Patstāvīgais darbs. Vērtējums 10 baļļu sistēmā.
Spēj izmantot praktiskas iemaņas lēmumu pieņemšanas metodikā dažāda līmeņa nenoteiktības apstākļos un dažādu parametru jutīguma analīzē.	Atrisināt 5-10 praktiskus uzdevumus. Kontroldarbs. Vērtēšana pēc 10 baļļu sistēmas.
Spēj izstrādāt un pielietot risku vadības programmu ražošanas un finanšu uzņēmējdarbības sektorā uzņēmumā.	Kompleksais praktiskais darbs. Vērtēšana pēc 10 baļļu sistēmas.

Patstāvīgo darbu veido literatūras izpēte, gatavošanās kontroldarbiem un mājas darba izpilde.	Gala pārbaude- eksāmens ar atzīmi.
---	------------------------------------

Studiju kursa plānojums

Daļa	KP	Stundas			Pārbaudījumi		
		Lekcijas	Prakt d.	Laborat	Ieskaite	Eksām.	Darbs
1.	5.0	16.0	16.0	16.0		*	