

**RTU studiju kurss "Finanšu instrumentu portfeļa veidošana (studiju projekts)"**

22000 Inženierekonomikas un vadības fakultāte

**Vispārējā informācija**

Kods	IV0291
Nosaukums	Finanšu instrumentu portfeļa veidošana (studiju projekts)
Studiju kursa statuss programmā	Obligātais/Ierobežotās izvēles
Atbildīgais mācībspēks	Konstantins Kozlovskis - Doktors, Asociētais profesors
Mācībspēks	Juris Straume - Pasniedzējs
Apjoms daļās un kredītpunktos	1 daļa, 3.0 kredītpunkti
Studiju kursa īstenošanas valodas	LV, EN
Anotācija	Studiju kurss dod iespēju iepazīties ar mūsdienu portfeļu teoriju, kurā ietilpst Markovica portfelis, Tobina portfelis, Šarpa portfelis un CAPM, un tās modifikācijas iespējas. Studiju kurss nodrošina šādu kompetenču attīstīšanu, kā: darbs ar literatūru un finanšu tirgus reālajiem datiem; portfeļa veidošana un testēšana; rezultātu interpretēšana; atskaites sagatavošana un prezentēšana.
Mērķis un uzdevumi, izteikti kompetencēs un prasmēs	Studiju kursa mērķis ir iemācīt studentus veidot investīciju portfeļus, ņemot vērā dažādas metodes, pieejas, teorijas. Studiju kursa uzdevumi: <ul style="list-style-type: none"> <li>• attīstīt teorētisko zināšanu portfeļu vadīšanā;</li> <li>• iemācīt pielietot iegūtās teorētiskās zināšanas reālo finanšu tirgu apstākļos;</li> <li>• attīstīt prasmi strādāt ar MS EXCEL investīciju portfeļa veidošanas kontekstā;</li> <li>• attīstīt iemaņas atskaišu sagatavošanā un galīgā rezultāta prezentācijā.</li> </ul>
Patstāvīgais darbs, tā organizācija un uzdevumi	Patstāvīgais darbs tiek organizēts saskaņā ar studiju projekta realizācijas plānu.
Literatūra	Bodie, Zvi. Investments and portfolio management / Zvi Bodie, Alex Kane, Alan J. Marcus. New York : McGraw-Hill, c2011., 1022, [37] lpp. : il., tab. ; 26 cm.  Reilly, Frank K.. Analysis of investments & management of portfolios / Frank K. Reilly, Keith C. Brown. Australia : South-Western Cengage Learning, c2012., xxvi, 1066 lpp. : il. ; 26 cm
Nepieciešamās priekšzināšanas	Matemātika, statistika, datormācība.

**Studiju kursa saturs**

Saturs	Pilna un nepilna laika klātienēs studijas		Nepilna laika neklātienēs studijas	
	Kontakt stundas	Patstāv. darbs	Kontakt stundas	Patstāv. darbs
Portfeļu teorijas attīstības posmi. Naīva diversifikācija.	2	0	1	0
Mūsdienīga portfeļu teorija: sastāvelementi, diversifikācijas būtība, priekšrocības un trūkumi.	4	4	2	6
Markovica pieeja portfeļa veidošanā.	10	8	3	20
Tobina pieeja portfeļa veidošanā.	10	10	3	14
Šarpa pieeja portfeļa veidošanā.	4	8	2	12
CAPM portfeļa veidošanā.	5	6	2	8
Atskaites par projekta sagatavošanu.	1	4	1	4
Rezultātu prezentēšana.	4	0	2	0
<b>Kopā:</b>	<b>40</b>	<b>40</b>	<b>16</b>	<b>64</b>

**Sasniedzamie studiju rezultāti un to vērtēšana**

Sasniedzamie studiju rezultāti	Rezultātu vērtēšanas metodes
Spēj veidot portfeļus no akcijām un akcijai līdzīgiem finanšu instrumentiem.	Prezentācija par 1. posma rezultātiem.
Prot modificēt portfeļu veidošanas teorijas portfeļu vadīšanas efektivitātes paaugstināšanai.	Prezentācija par 2. posma rezultātiem.
Prot pielietot iegūtās teorētiskās zināšanas un praktiskās iemaņas portfeļa veidošanai reālos finanšu tirgos.	Projekta atskaite un gala prezentācija.
Spēj prezentēt projekta rezultātus.	Diskusija par projekta rezultātiem.

**Studiju rezultātu vērtēšanas kritēriji**

Kritērijs	% no kopējā vērtējuma
Prezentācija par 1. posma rezultātiem	25
Prezentācija par 2. posma rezultātiem	25
Projekta atskaite un gala prezentācija	30
Diskusija par projekta rezultātiem	20
Kopā:	100

**Studiju kursa plānojums**

Daļa	KP	Stundas			Pārbaudījumi		
		Lekcijas	Prakt d.	Laborat	Ieskaite	Eksām.	Darbs
1.	3.0	0.0	40.0	0.0			*