

## RTU studiju kurss "Investīciju vadība"

01B00 Rīgas Biznesa skola

**Vispārējā informācija**

Kods	BS0057
Nosaukums	Investīciju vadība
Studiju kursa statuss programmā	Obligātais/Ierobežotās izvēles
Atbildīgais mācītbspēks	Raimonds Lieksnis - Doktors, Docents
Apjoms daļās un kredītpunktos	1 daļa, 4.0 kredītpunkti, 6.0 EKPS kredītpunkti
Studiju kursa īstenošanas valodas	LV, EN
Anotācija	Studiju kurss sniedz vispārēju izpratni par kapitāla tirgus darbību un vienkāršām, analītiskām metodēm investīciju pārvaldīšanai. Studiju kursā tiek apskatītas šādas tēmas: novērtēšanas metodes, riska analīze, kredītportfeļa teorija, kapitāla aktīvu cenu noteikšanas modelis (CAPM), tirgus mikrostruktūra, indeksa modeļi, arbitražas cenu noteikšanas modeļi, obligācijās un kopējo krājumu novērtēšana, efektīvas tirgus prognozes, investīciju vadība. Studentiem ir iespēja pieņemt īstus investīcijas vadības lēmumus, izmantojot Stock -Trak Portfolio Simulations.
Mērķis un uzdevumi, izteikti kompetencēs un prasmēs	Studiju kursa galvenais mērķis ir sniegt zināšanas par finanšu un vērtspapīru tirgu, finanšu starpniekiem un finanšu iestādēm, kā arī dažādiem finanšu instrumentiem. Studiju kursa uzdevumi ir: - iemācīt studentiem strādāt ar finanšu instrumentiem (akcijas, obligācijas, atvasinātie finanšu instrumenti) – veikt to novērtēšanu un investīcijas tajos; - iepazīstināt studentus ar ieguldījumu portfeļu pārvaldi; - sniegt studentiem ieskatu CFA (Chartered Financial Analyst) programmā.
Patstāvīgais darbs, tā organizācija un uzdevumi	Gatavošanās kontroldarbiem, starpsemestra un gala eksāmeņiem. Mājasdarbu izpilde un prezentāciju izveide.
Literatūra	Obligātā/Obligatory: Investments, Global Edition, 12th Edition, by Zvi Bodie, Alex Kane, Alan Marcus, Published by McGraw-Hill Education (UK) Ltd, 2021. Papildu/Additional: 1. J.P.Morgan Asset Management. Long-term Capital Market Assumptions. 26th Annual Edition, 2022. 2. Investment Valuation - Tools and Techniques for Determining the Value of Any Asset, Third Edition, by Aswath Damodaran. 2012. 3. Asset Management – Portfolio Construction, Performance and Returns. Satchell, Stephen, Palgrave Macmillan, 2016. 4. Wilmott, Paul. Frequently Asked Questions in Quantitative Finance. Wiley.2010. 5. DiBruno, Rocco. How to Write an Investment Policy Statement. Wiley.2013.
Nepieciešamās priekšzināšanas	Finanšu vadīšana.

**Studiju kursa saturs**

Saturs	Pilna un nepilna laika klātienes studijas		Nepilna laika neklātienes studijas	
	Kontakt stundas	Patstāv. darbs	Kontakt stundas	Patstāv. darbs
Ieguldījumu vide, aktīvu kategorijas un finanšu instrumenti.	4	8	0	0
Kapitāla izvietošana riskantos aktīvos, aktīvu vēsturiskās atdeves.	6	8	0	0
Optimāli riskanti portfeļi.	4	8	0	0
Ieguldījumu politika un CFA Institūta politikas dokumenti.	6	8	0	0
Vērtspapīru vērtības analīze: pašu kapitāla novērtējuma modeļi, finanšu pārskata analīze.	4	8	0	0
Kā vērtspapīri tiek tirgoti. Kā rīkoties finanšu un tehniskās analīzes jomā. Riska kapitāla fondi.	6	8	0	0
Opcijas un nākotnes darījumi: ievads, tirgi, atdeve.	6	8	0	0
Fiksētie ienākumu vērtspapīri: obligāciju cenas un ienesīgums.	6	8	0	0
Fiksētie ienākumu vērtspapīri: procentu likmju struktūra, obligāciju portfeļa vadība.	6	8	0	0
Lietiskā portfolio pārvaldība.	8	18	0	0
Prezentācijas.	8	6	0	0
<b>Kopā:</b>	<b>64</b>	<b>96</b>	<b>0</b>	<b>0</b>

**Sasniedzamie studiju rezultāti un to vērtēšana**

Sasniedzamie studiju rezultāti	Rezultātu vērtēšanas metodes
Spēj izskaidrot kapitāla tirgus darbību.	Mājasdarbi, kontroldarbi, prezentācijas, starpsemestra un gala eksāmeni.
Spēj izmantot ieguldījumu pārvaldības analītiskos instrumentus.	Mājasdarbi, kontroldarbi, prezentācijas, eksāmeni.
Prot pielietot diskontētās naudas plūsmas metodi akciju un obligāciju novērtēšanai.	Mājasdarbi, kontroldarbi, prezentācijas, eksāmeni.

Spēj veikt praktiskus darījumus finanšu tirgos, un paskaidrot to mērķi, analizēt ieguldījumu rezultātus.	Investīciju simulācijas spēle Stocktrak – atskaite un prezentācija.
--	---

**Studiju rezultātu vērtēšanas kritēriji**

Kritērijs	% no kopējā vērtējuma
Investīciju spēle Stocktrak – atskaite un prezentācijas	30
Mājasdarbi	10
Starpsemestra eksāmens	20
Gala eksāmens	30
Četri kontroldarbi klasē	10
Kopā:	100

**Studiju kursa plānojums**

Daļa	KP	Stundas			Pārbaudījumi		
		Lekcijas	Prakt d.	Laborat	Ieskaite	Eksām.	Darbs
1.	4.0	64.0	0.0	0.0		*	