

STUDIJU KURSA APRAKSTS

Studiju kursa nosaukums	Finanšu modelēšana un prognozēšana		
Programma	Finanšu vadība		
Studiju gads	1.		
Studiju līmenis	Maģistra studiju programma		
Studiju kursa kods	MFV004		
Studiju kursa docētājs/i	Aivars Spilbergs		
Kursa apjoms	6 KP		
Studiju īstenošanas valoda	Latviešu		
Studiju kursa veids (obligātais, izvēles)	Obligāts		
Semestris, kad kurss tiek īstenots	1.		
Studiju kursa īstenošanas veids	Docētāja klātbūtne		
Kursa īstenošanas mērķis	Studiju kursa mērķis ir attīstīt prasmes un iemaņas finanšu modelēšanā un prognozēšanā, kā arī kvantitatīvo un kvalitatīvo metožu pielietošanā uzņēmumu un finanšu ieguldījumu vērtības noteikšanai.		
Prasības studiju kursa apguves uzsākšanai	Ekonomika, finanšu teorija, uzņēmumu finanses, finanšu instrumentu un investīciju analīze, statistika, ekonometrija un finanšu matemātika.		
Studiju kursa saturs	<ol style="list-style-type: none"> 1. Finanšu modelēšanas pamatprincipi; 2. Finanšu pārskatu modelēšanas un prognozēšanas process; 3. Laika rindu analīzes metodes finanšu rādītāju prognozēšanai; 4. Regresijas analīzes metodes finanšu rādītāju prognozēšanai; 5. Finanšu modeļi uzņēmumu un ieguldījumu vērtības noteikšanai; 6. Finanšu rādītāju jutīguma analīze; 7. Scenāriju analīze ar finanšu modeļiem; 8. Monte Carlo simulācijas finanšu modelēšanā. 		
Studējošo patstāvīgā darba organizācija un uzdevumi	Students apmeklē lekcijas, piedalās semināros, izpilda patstāvīgos darbus. Kopīgo vērtējumu studiju kursa apguvei veido: 65% studiju procesa laikā veiktie patstāvīgie darbi, 25% patstāvīgā darba rezultātu un secinājumu prezentācija, 10% aktīva līdzdalība semināros.		
Plānotās studiju formas un mācīšanas metodes	Studiju metodes	Studenta noslodze	
		Pilns laiks	Tālmācība
	Lekcijas	7.5%	10%
	Semināri	2.5%	-
	Pastāvīgā darba sagatavošana	37,5%	-
	Pastāvīgā darba prezentācija	2.5%	40%
	Darbs bibliotēkā, patstāvīgas studijas	50%	50%
	Kopā 100%		

Plānotie studiju rezultāti (zināšanas, prasmes, kompetences)	<ol style="list-style-type: none"> Spēja izvērtēt tautsaimniecības nozaru attīstību. Spēja iegūt un analizēt informāciju/datus, kas iegūti no specifiskām datu bāzēm un reģistriem. Spējas izvēlēties atbilstošas modelēšanas un prognozēšanas metodes uzņēmumu un ieguldījumu vērtības novērtēšanai, loģiski interpretēt iegūtos rezultātus. Spēja prognozēt ekonomikas un finanšu tirgus attīstību. Spēja izstrādāt darbības attīstības scenārijus, pielietojot zināšanas dažādās jomās. 																																		
Studiju rezultātu vērtēšanas metodes un kritēriji	<table border="1"> <thead> <tr> <th data-bbox="486 571 877 638">Studiju rezultāti</th> <th data-bbox="885 571 1029 638">1.</th> <th data-bbox="1037 571 1181 638">2.</th> <th data-bbox="1189 571 1332 638">3.</th> <th data-bbox="1340 571 1452 638">4.</th> <th data-bbox="1460 571 1572 638">5.</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td data-bbox="486 638 877 683">Pārbaudes forma</td> <td data-bbox="885 638 1029 683"></td> <td data-bbox="1037 638 1181 683"></td> <td data-bbox="1189 638 1332 683"></td> <td data-bbox="1340 638 1452 683"></td> <td data-bbox="1460 638 1572 683"></td> </tr> <tr> <td data-bbox="486 683 877 750">Aktīva līdzdalība semināros</td> <td data-bbox="885 683 1029 750">●</td> <td data-bbox="1037 683 1181 750">●</td> <td data-bbox="1189 683 1332 750">●</td> <td data-bbox="1340 683 1452 750">●</td> <td data-bbox="1460 683 1572 750">●</td> </tr> <tr> <td data-bbox="486 750 877 817">Patstāvīgā darba rezultāti un prezentācijas sagatavošana</td> <td data-bbox="885 750 1029 817">●</td> <td data-bbox="1037 750 1181 817">●</td> <td data-bbox="1189 750 1332 817">●</td> <td data-bbox="1340 750 1452 817">●</td> <td data-bbox="1460 750 1572 817">●</td> </tr> <tr> <td data-bbox="486 817 877 884">Darba rezultātu prezentācija</td> <td data-bbox="885 817 1029 884">●</td> <td data-bbox="1037 817 1181 884">●</td> <td data-bbox="1189 817 1332 884">●</td> <td data-bbox="1340 817 1452 884">●</td> <td data-bbox="1460 817 1572 884">●</td> </tr> </tbody> </table>					Studiju rezultāti	1.	2.	3.	4.	5.	Pārbaudes forma						Aktīva līdzdalība semināros	●	●	●	●	●	Patstāvīgā darba rezultāti un prezentācijas sagatavošana	●	●	●	●	●	Darba rezultātu prezentācija	●	●	●	●	●
Studiju rezultāti	1.	2.	3.	4.	5.																														
Pārbaudes forma																																			
Aktīva līdzdalība semināros	●	●	●	●	●																														
Patstāvīgā darba rezultāti un prezentācijas sagatavošana	●	●	●	●	●																														
Darba rezultātu prezentācija	●	●	●	●	●																														
Obligātā un papildliteratūra	<p>Pamata literatūra:</p> <ol style="list-style-type: none"> Benninga S. Financial Modeling. MIT Press, 4th ed., 2014. Damodaran A. Investment Valuation. Wiley&Sons, 3 ed., 2012. <p>Papildu literatūra:</p> <ol style="list-style-type: none"> Swan J. Practical Financial Modelling. Elsevier Butterworth Heinemann. 2016 Rees M. Principles of Financial Modelling: Model Design and Best Practices Using Excel and VBA, John Wiley & Sons, 2018 Hitchner J. Financial Valuation: Applications and Models, 4th ed., John Wiley & Sons, 2017 Clark, T. E., McCracken, M. W., & Mertens, E. Modeling Time-Varying Uncertainty of Multiple-Horizon Forecast Errors. The Review of Economics and Statistics, 2020, 102(1), 17–33. Jung, W., Lee, J.H. Quantile impulse response analysis with applications in macroeconomics and finance. Advances in Econometrics, 2022. Spilbergs, A. (2023). Financial services digitainability: financial inclusion and efficiency in EU countries. WSEAS Transactions on Business and Economics, 20, 128, 1448-1462.DOI: 10.37394/23207.2023.20.128 Spilbergs, A. (2022). Comparative analysis of non-performing loans affecting factors in the Baltic States. Journal of Economic and Social Development (JESD). Resilient Society, 9(1), 10-18. https://doi.org/10.55539/jesd.9.1.2 Spilbergs, A. (2020) Non-Performing Loans Ratio Measurement and Determinants Assessment. J. of Accounting and Finance, 20(8), 35 – 44. Spilbergs, A. (2020). Residential Mortgage Loans Delinquencies Analysis and Risk Drivers Assessment. Emerging Science Journal, 4 (2), 104-112. http://dx.doi.org/10.28991/esj-2020-01214. Spilbergs, A., Fomins, A., Krastins, M. (2021). Impact of macroeconomic factors on the MTPL insurance in Latvia. Littera Scripta, 14 (1), 149-163. https://doi.10.36708/Littera_Scripta2021/1/12 																																		

- | | |
|--|--|
| | <p>10. Spilbergs, A., Fomins, A., and Krastins, M. (2022). Multivariate Modelling of Motor Third Party Liability Insurance Claims. <i>European J. of Business Science and Technology</i>, 8 (1), 5–18, DOI 10.11118/ejobsat.2022.002</p> |
|--|--|