

Jekaterina Nazarova

**Prognozēšanas un lēmumu
pieņemšanas modeļi mūsdienu
vērtspapīru tirgū**

GlobeEdit

SATURS

ANOTĀCIJA	3
IEVADS.....	4
1. TEORĒTSKĀ DAĻA.....	7
1.1. VĒRTSPAPĪRU ANALĪZES UN NĀKOTNES CENU PROGNOZĒŠANAS METODES LĒMUMU PIEŅEMŠANAS KONTEKSTĀ	7
1.1.1. Vērtspapīru analīzes un nākotnes cenas prognozēšanas metožu konceptuālā metodoloģija.....	7
1.1.2. Fundamentālās analīzes paņēmieni lēmumu pieņemšanas procesā	8
1.1.3. Tehniskās analīzes instrumentu pielietošana stratēģijas izvēlē	16
1.2. INVESTĪCIJU PORTFEĻA SASTĀDĪŠANAS PAŅĒMIENI UN METODOLOĢIJA 29	
1.2.1. Investīciju portfeļa nozīme un klasifikācija.....	29
1.2.2. Lēmumu pieņemšana investīciju portfeļa sastādīšanā.....	30
1.2.3. Sastādāmā portfeļa riska pakāpes novērtēšana	39
2. ANALĪTISKĀ DAĻA	41
2.1. FUNDAMENTĀLĀS ANALĪZES PIELIETOJUMS LĒMUMU PIEŅEMŠANĀ	41
2.1.1. Modelēšanā izmantotu vērtspapīru atlases pamatojums.....	41
2.1.2. Uzņēmuma finanšu rādītāju fundamentālā analīze	42
2.1.3. Makroekonomisku faktoru korelācijas un regresijas analīze.....	46
2.2. TEHNISKĀS ANALĪZES IZMANTOŠANA INVESTĒŠANAS STRATĒĢIJAS IZVĒLEI.....	50
2.2.1. Tehniskās analīzes instrumentu pielietojums lēmumu pieņemšanā.....	50
2.2.2. Tehniskās analīzes rezultātu interpretēšana un investēšanas stratēģijas izveidošana	59
2.3. INVESTĪCIJU PORTFEĻA KORELATĪVI-KOHERENTA VEIDOŠANA UZ ATLASĪTU AKCIJU PAMATA	60
2.3.1. Investīciju portfeļa stratēģijas izveidošana balstoties uzmodelēšanas rezultātiem.....	60
2.3.2. Investīciju portfeļa strukturēšana pēc Markovica metodes	61
3. ZINĀTNISKI PRAKTISKĀ DAĻA.....	64
3.1. KOMPLEKSĀS PROGNOZĒŠANAS UN IMPLEMENTĒJAMĀ INSTRUMENTĀRIJA RACIONALIZĒŠANAS NOTEIKŠANA LĒMUMU PIEŅEMŠANAS MODEĻA SASTĀDĪŠANĀ	64
3.1.1. Kompleksi - svērtā modeļa būtības un aktualitātes apraksts	64
3.1.2. Modeļa veidošana un tai nepieciešamo koriģējošo koeficientu aprēķins un pielietojums.....	66
3.1.3. Izveidota kompleksi - svērtā modeļa variāciju sastādīšana un optimālās kombinācijas izvēle.....	72
3.2. IZVEIDOTĀ MODEĻA IMPLEMENTĒŠANA UN PĀRBAUDE PRAKSĒ	76
3.2.1. Racionalizētā instrumentārija implementēšanas konsekvences un modeļa analītisks apkopojums	76
3.2.2. Teorētiski atbalstītās hipotēzes praktiskās īstenošanas pārbaude un koriģējošs novērtējums.....	91
NOBEIGUMS	93
BIBLIOGRĀFISKAIS SARAKSTS	96