Pénzügy mesterszak
Záróvizsga tételsor

1) Mutassa be a Markowitzi portfólióelméletet, valamint a hozam–kockázat mérést a kockázatos portfóliók esetében! Ismertesse a portfólióoptimalizálás lehetőségeit! Mutassa be a tőkepiaci árazási modelleket (CAPM, APT)!

2) Mutassa be a nyitott és zárt, long és short pozíciókat, valamint a spekuláns és fedezeti szereplőket! Ismertesse a futures ügyletek működését! Mutassa be a határidős árfolyam meghatározásának alapmodelljét! Térjen ki a kincstárjegyekre, devizákra, részvényekre, tartási arbitrázsra és FRA ügyletekre!

3) Ismertesse a spot és forward kamatrátákat, a loghozamokat és a diszkontfaktorokat és szerepüket a kötvények értékelésének területén! Térjen ki a duration és konvexitás (görbület) mutatók gazdasági tartalmára!

4) Mutassa be a diszkrét, folytonos, determinisztikus és sztochasztikus folyamatokat és pénzügyi jelentőségüket! Ismertesse a részvényárfolyam alakulásának folytonos sztochasztikus modelljét, illetve az EMH feltételeit. Mutassa be a Wiener folyamatot!

5) Mutassa be az opciók árazását diszkrét esetben! Ismertesse a diszkrét árazáshoz kapcsolódó nevezetes eloszlások jellemzőit és gyakorlati alkalmazásukat az opciók árazásában! Mutassa be a binomiális fákat és a Cox-Ross-Rubinstein modell szerinti opcióárazást!

6) Mutassa be az opciók árazását folytonos esetben! Ismertesse a folytonos árazáshoz kapcsolódó nevezetes eloszlások jellemzőit és gyakorlati alkalmazásukat az opciók árazásában! Mutassa be a Black-Scholes modellt!

7) Ismertesse az opciós prémiumot meghatározó tényezőket! Ismertesse a „görögök” alapjellemzőit! Mutassa be a görögök kapcsolatát a B-S modellel! Értelmezze a delta és gamma értékét ITM,ATM és OTM opciók esetén! Mutassa be a delta hedget, térjen ki a gamma szerepére a folyamatban!

8) Mutassa be a swap ügyleteket! Ismertesse a hedge stratégiákat! Mutassa be hogyan használhatóak fel határidős ügyletek részvényportfoliók bétájának beállítására és kötvényportfoliók kamatimmunizációjára!

9) Mutassa be a nemzetközi fizetési mérleg felépítését! Térjen ki a tartozik és követel tételek szabályaira a nemzetközi fizetési mérleg összeállítása során! Értelmezze a devizapiaci keresletet és kínálatot a fizetési mérleg összefüggésében! Mutassa be a sterilizált devizapiaci intervenciókat a sematizált jegybanki mérleg függvényében!

10) Mutassa be a bázeli tőkeszabályozást és a szerepét a nemzetközi bankrendszer működésében? Fejtse ki, hogy miért vált szükségessé a szabályozás bevezetése, milyen célokat szolgál, és hogyan járul hozzá a pénzügyi stabilitás fenntartásához!

11) Ismertesse a jegybanki mérleg sematikus felépítését (kitérve a végső elszámoló szerepére) és a jegybanki eredményt! Mutassa be az exogén és endogén pénzelméletet! Mutassa be a monetáris transzmissziót és a transzmissziós csatornákat!
12) Mutassa be a binomiális és trinomiális kamatlábfákat! Mutassa be a kamatláb modelleket! Ismertesse a Vasicek és Hull-White modellt!

13) Mutassa be a vállalkozások vagyonának, pénzügyi helyzetének és jövedelmezőségi helyzetének elemzési lehetőségeit! Értelmezze az egyes vállalati pénzügyi részterületekhez kapcsolódó mutatókat és azok gyakorlati alkalmazását!

14) Ismertesse a vállalatértékelési módszerek csoportjait, az egyes csoportok értékelési koncepcióját! Mutassa be a szorzószámokon alapuló módszereket és gyakorlati alkalmazásukat! Ismertesse a szabad cash flow alapú értékelést!

15) Mutassa be a társasági adózás rendszerét, az adó meghatározásának folyamatát és ismertesse a halasztott adó keletkezésének okait és módszertanát!

Prof. Dr. Becsky-Nagy Patrícia

egyetemi tanár, szakvezető