

Pénzügy mesterszak

Befektetéselemző specializáció

„A” témakörlista

Indexkövető befektetési termékek (Hozamok, idősorok, indexek)

- ETF-ek és index követő befektetési alapok
- Tőzsdén kereskedett kötvények (ETN)
- Egyéb termékek

Index módszertan (Hozamok, idősorok, indexek)

- Indexek alkotóelemei
- Súlyozás
- Index szint kiszámítása

Lineáris regressziós modell (Ökonometria)

- Klasszikus legkisebb négyzetek módszere (OLS)
- Paraméterértelmezés, magyarázó erő (R²)
- Modellszelekció: Wald F-teszt, modellszelekciós kritériumok

Bináris logit regresszió (Ökonometria)

- Maximum likelihood becslés módszere
- Paraméterértelmezés, feltételes valószínűség
- McFadden pszeudó-R², Likelihood-arány teszt

Eszközárzási anomáliák és magyarázataik (Befektetéselmélet)

- Naptári hozammintázatok
- Átlaghoz való visszatérés
- Tőkepiaci mikrostruktúra és viselkedési pénzügyek

Egyensúlyi modellek (Befektetéselemzés)

- CAPM és a likviditás prémium modell
- Többfarktoros modellek
- Arbitrált árfolyamok elmélete

„B” témakörlista

Tőkepiaci hatékonyság definíciója és gyenge szintje (Tőkepiaci hatékonyság)

- Tőkepiaci hatékonyság definíciója és szintjei

- A gyenge szint tesztsjei és ezek eredményei
- A technikai elemzés és ennek használhatósága a fentiek tükrében

Tőkepiaci hatékonyság félerős és erős szintje (Tőkepiaci hatékonyság)

- Félerős szint tesztsjei és általános eredményei
- Erős szint tesztsjei és tanulságai
- A fundamentális elemzés használhatósága a félerős és erős szint tesztsjei eredményeinek ismeretében

Banki kockázatok és ezek kezelése (Bankügyletek)

- Hitelkockázat és kezelése
- Piaci és likviditási kockázat és kezelése
- Működési kockázat és kezelése

Bankok szabályozása (Bankügyletek)

- Bázeli I. és II.
- Bázeli III.
- Bankok felügyelete

Határidős ügyletek és opciók (Származtatott termékek és reálopciók)

- Határidős és opciós ügyletek alapfogalmai és tőzsdei kereskedése
- Opcióértékelés
- Reálopciók