

Kaposvári Egyetem Gazdaságtudományi Kar
Kaposvár, Guba Sándor u. 40.

TEMATIKA ÉS KÖVETELMÉNYRENDSZER

Tantárgy neve: Pénzügyi számítások és pénzügyi piacok

Tantárgy kódja(i): 3BNPS2-EA-PÜISZÁMÍTPÜIPIACOK

Képzési szint: FOSZK/alapképzés/mesterképzés

Szak(ok) neve(i): Pénzügy és számvitel

Tagozat: nappali/levelező

Óraszám (ea/gy): 2/2

Értékelési forma: kollokvium/gyakorlat

Tantárgyfelelős oktató: Varga József

Előadás- és gyakorlatvezető oktatók: Gál Veronika Alexandra, Bareith Tibor

Tantárgyat gondozó tanszék neve: Pénzügy és Közgazdaságtan Tanszék

Tanszékvezető neve, beosztása: Parádi-Dolgos Anett, egyetemi docens

A tematika és követelményrendszer érvényessége: 2014/2015. tanév II. félév

A tantárgy céljai:

A Vállalati pénzügyek tantárgy keretében elsajátított ismeretekre építve Excel program segítségével egyszerű gazdasági számítások, elemzések és modellek megismertetése. Többek között EBKM, THM számítás, kötvény és részvény elemzések és a devizakockázat modellezése.

Követelmények és az értékelés módja:

A gyakorlatokon a megjelenés és aktív részvétel kötelező.

A félév aláírásának feltétele a gyakorlatokon való részvétel és a kisdolgozatokból min. 50% teljesítése.

A félév gyakorlati jeggyel zárul, mely a következők alapján kerül meghatározásra:

Kisdolgozatok:	10 pont	* 5 =	50 pont (min. 25 pont)
Házi feladatok:	8 pont	* 5 =	40 pont
Prezentáció:	4 pont	* 3 =	12 pont
Összesen:			102 pont

A félév végi jegyek ponthatárai:

2-es	51–62 százalék
3-as	63–74 százalék
4-es	75–86 százalék
5-ös	87–100 százalék

A tantárgy témakörei:

SSZ.	ÓRA TÍPUSA	ELŐADÁS TÉMA	SZEMINÁRIUM TÉMA
1.	előadás és szeminárium	Követelményrendszer ismertetése, csoportok felosztása	Bevezető feladatok, ismerkedés az Excel pénzügyi függvényeivel
2.	előadás és szeminárium	Kötvények típusai, árazása	Kötvényárazási feladatok különböző törlesztési konstrukciók esetén
3.	előadás és szeminárium	Kamatlábak összefüggései, hozamgörbe szemléltetése	1. kisdolgozat, 1. házi feladat prezentálása
4.	előadás és szeminárium	Pénzügyi piacok	EBKM, THM számítás
5.	előadás és szeminárium	Hiteltörlesztési módok hatása a THM-re	2. kisdolgozat, 2. házi feladat prezentálása
6.	előadás és szeminárium	Járadékok (annuitás, örökjáradék)	Diákhitel törlesztés
7.	előadás és szeminárium	Árfolyam- és kamatláb kockázat modellezése	3. kisdolgozat, 3. házi feladat prezentálása
8.	előadás és szeminárium	Részvényárfolyamok becslése, fundamentális elemzési módszerek	Részvényárfolyam elemzések, értékpapírok kockázata és hozama
9.	TAVASZI OKTATÁSI SZÜNET		
10.	előadás és szeminárium	Részvényárfolyamok technikai elemzése	4. kisdolgozat, 4. házi feladat prezentálása
11.	előadás és szeminárium	Portfólióelmélet, tőkepiaci árfolyamok modellje (CAPM)	Portfóliók kockázata és hozama, β és elvárt hozam becslése
12.	előadás és szeminárium	Pénzügyi piacok indexei, befektetési alapok	5. kisdolgozat, 5. házi feladat prezentálása
13.	előadás és szeminárium	Derivatív piacok, származtatott pénzügyi termékek	Opciós pozíciók előállítás, összetett pozíciók szemléltetése
14.	előadás és szeminárium	Pénzügyi innovációk	Pótlási lehetőség, érdemjegyek meghatározása

Szakirodalom

Kötelező irodalom

- Előadások anyagai
- Fazekas - Gáspár - Soós: Bevezetés a pénzügyi és vállalati pénzügyi számításokba. Tanszék Kiadó Kft., Budapest, 2008. vagy 2010.
- Szerk. Fazekas Gergely: Vállalati pénzügy példatár (és képletgyűjtemény), Tanszék Kiadó Kft., Budapest, 2008.

Ajánlott irodalom

- Brealey–Myers: Modern vállalati pénzügyek (1 vagy 2 kötetes), Panem Kiadó, Budapest, 2005.

Kaposvár, 2015. január 20.


Oktató aláírása


Tanszékvezető aláírása