

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

TEMATIKA ÉS KÖVETELMÉNYRENDSZER

Tantárgy neve: Befektetési és értékpapír-piaci ismeretek

Tantárgy kódja(i): 3FPKG1BÉI00001

Képzési szint: alapképzés

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

Tagozat: nappali

Óraszám (ea/gy): 2/1

Értékelési forma: írásbeli vizsga

Tantárgyfelelős oktató: Sipiczki Zoltán

Előadás- és gyakorlatvezető oktatók: Sipiczki Zoltán

Tantárgyat gondozó tanszék neve: Pénzügy és Közgazdaságtan Tanszék

Tanszékvezető neve, beosztása: Parádi-Dolgos Anett egyetemi docens

A tematika és követelményrendszer érvényessége: 2015/2016 tanév I. félév

A tantárgy céljai: A befektetési piacok elméletének és gyakorlatának összekapcsolása

Követelmények és az értékelés módja:

Írásbeli vizsga a vizsgaidőszakban.

Ponthatárok:

0 – 49 pont: elégtelen (1)

50 – 59 pont: elégséges (2)

60 – 69 pont: közepes (3)

70 – 79 pont: jó (4)

80 – 100 pont: jeles (5)

A tantárgy témakörei:

SSZ.	ÓRA TÍPUSA	ELŐADÁS TÉMA	SZEMINÁRIUM TÉMA
1.	előadás	Kereskedés a pénzügyi piacokon, Befektetési formák ismertetése	Hozam, Kockázat, Likviditás számítás, Bankbetétek kamatszámolása
2.	előadás	Portfólióelmélet és CAPM; Vállalati érték meghatározás	Capital Asset Pricing Model számítás,
3.	előadás	Értékpapírok: Kötvény Részvény, Befektetési alapok	Nettó jelenérték Belső megtérülési ráta Névleges kamatláb
4.	előadás	Befektetési stratégiák, Technikai árfolyamelemzés	Bruttó árfolyam Nettó árfolyam A lejárat hozam
5.	előadás	Derivatív ügyletek; Határidős ügyletek jellemzői, spekuláció elemi határidős ügyletekkel	A kötvény pénzáramlásai A részvény árazása
6.	előadás	Kockázatkezelés; Arbitrázs; Opciók	portfólió relatív szórásának számítása, Opció árazás
7.	előadás	Likviditás, Tőzsde, Tőzsdei ajánlattípusok	Portfólió kockázata (szórása) A portfólió bétája
8.	előadás	Pénzügyi válságok régen: Latin Amerika, Kelet Ázsia, dotcom válságok okai és tanulságai	Részvényárra ható piaci tényezők
9.	előadás	Pénzügyi válságok ma, 2008-2009-es recesszió válságok okai és tanulságai	Részvényárra ható piaci tényezők
10.	előadás	Piaci pszichológia	Kamatcsere (interest rate swap) ügyletek számítása
11.	előadás	Fundamentális elemzés; Aktív és passzív befektetési stratégia	Likviditási, Jövedelmezőségi mutatók számítása
13.	előadás	Mutatószerzők; A mutatóelemzés főbb korlátai; Likviditási, Jövedelmezőségi mutatók, Hatékonysági mutatók, Tőkeáttételi mutatók,	Hatékonysági, Tőkeáttételi mutatók számítása
14.	előadás	Összefoglalás	Összefoglalás

Szakirodalom

Kötelező:

Az előadások anyaga.

Ajánlott:

Bodie – Kane – Marcus: Befektetések

Kaposvár, 2015. augusztus 28..

Oktató aláírása

Tanszékvezető aláírása