**Pytania egzaminu dyplomowego**

**Finanse i rachunkowość, Studia II stopnia**

**Specjalność: ANALITYKA FINANSOWA**

1. Omów czynniki wpływające na koniunkturę na rynkach finansowych.
2. Omów interakcje pomiędzy rynkami finansowymi a sferą realnej gospodarki.
3. Omów specyfikę funduszy typu REIT.
4. Omów specyfikę funduszy typu PE/VC.
5. Omów specyfikę funduszy typu hedge.
6. Proszę omówić metody oceny projektów inwestycyjnych
7. Proszę omówić płaszczyzny analizy finansowej
8. Proszę omówić płaszczyzny zarządzania kapitałem obrotowym netto w przedsiębiorstwie.
9. Proszę przedstawić założenia koncepcyjne kosztu kapitału własnego w przedsiębiorstwie.
10. Wymień i omów podstawowe typy oraz rodzaje transakcji fuzji i przejęć.
11. Wymień i omów poglądy (szkoły/hipotezy) na temat wpływu wypłat dywidendy na wartość rynkową przedsiębiorstwa.
12. Modele wyceny przedsiębiorstw bazujące na zyskach rezydualnych.
13. Modele dywidendowe wyceny przedsiębiorstw - etapy, zastosowanie i ograniczenia modeli.
14. Proszę omówić podstawowe struktury danych w programie R.
15. Proszę scharakteryzować podejście analizy technicznej, podać i omówić przykładowe wskaźniki analizy technicznej i oprogramowanie wspierające analizę techniczną.
16. Proszę scharakteryzować pojęcie krzywej dochodowości i omówić metody jej estymacji.
17. Proszę wymienić i krótko scharakteryzować przynajmniej dwie klasy modeli szeregów czasowych stosowanych w uczeniu maszynowym.
18. Generatory liczb pseudolosowych w symulacji stochastycznej.
19. Wycena opcji europejskich w modelu dyskretnym i ciągłym.
20. Wycena opcji wstecznych i azjatyckich.
21. Miary wrażliwości opcji.
22. Wycena obligacji o stałym i zmiennym oprocentowaniu.
23. Wycena kontraktów terminowych na stopę procentową.
24. Swapy - konstrukcja i wycena.
25. Koncepcja miar ryzyka i ich rodzaje.
26. Ryzyko rynkowe i rynkowy value at risk.
27. Ryzyko kredytowe i kredytowy value at risk.
28. Metody analizy dyskryminacyjnej i klasyfikacji statystycznej w pomiarze ryzyka kredytowego.
29. Ryzyko operacyjne i sposoby jego  pomiaru.
30. Testy wsteczne w ocenie ryzyka finansowego.