

Pytania egzaminu dyplomowego

Studia II-go stopnia

Kierunek: RYNKI FINANSOWE

- 1. Czas trwania i wypukłość obligacji**
- 2. Wrażliwość obligacji standardowych na zmiany stóp procentowych**
- 3. Hybrydowe papiery wartościowe – pojęcie i charakterystyka**
- 4. Wycena opcji na instrumenty generujące dyskretne przepływy finansowe w modelu ciągłym i dyskretnym**
- 5. Wycena opcji zależnych od trajektorii (opcje azjatyckie, opcje lookback)**
- 6. Wycena opcji amerykańskich w modelu dwustanowym**
- 7. Wycena obligacji w modelu ciągłym i dyskretnym**
- 8. Wycena kontraktów forward i futures – podobieństwa i różnice.**
- 9. Zasady sprawiedliwej wyceny kontraktów terminowych na stopę procentową.**
- 10. Zasady konstrukcji i wyceny swapów**
- 11. Wycena opcji na swap w modelu dyskretnym**
- 12. Wycena opcji egzotycznych w modelu dyskretnym**
- 13. Wycena opcji na stopę procentową w modelu ciągłym i dyskretnym**
- 14. Ogólna charakterystyka transakcji fuzji i przejęć: typy transakcji i ich klasyfikacja**
- 15. Taktyki ofertowe stosowane w transakcjach fuzji i przejęć**
- 16. Teoria sygnalizacji dywidendowej**
- 17. Rodzaje polityki dywidendowej**
- 18. Dywidendowa teoria cyklu życia spółki**
- 19. Motywy i korzyści z handlu zagranicznego motywy i korzyści – przewaga komparatywna**
- 20. Bilans płatniczy – struktura i równowaga bilansu**
- 21. Rodzaje kursów walutowych i ich rola w gospodarce**
- 22. Ewolucja międzynarodowego systemu walutowego**
- 23. Kryzysy finansowe we współczesnej gospodarce światowej – rodzaje, problem globalnych nierównowag, finansjalizacja cykliczności**
- 24. Obowiązki doradcy wobec pracodawcy i klienta – aspekty etyczne**
- 25. Zasady przygotowania rekomendacji inwestycyjnych**
- 26. Zasady nadzoru właścicielskiego w spółkach giełdowych**
- 27. Krótkoterminowe decyzje finansowe podejmowane w przedsiębiorstwie**
- 28. Metody oceny efektywności projektów inwestycyjnych**
- 29. Rozkład Bernoulliego oraz rozkład normalny – postacie, podstawowe parametry, przykłady zastosowań w finansach**

30. **Prawdopodobieństwo warunkowe, prawdopodobieństwo całkowite, wzór Bayesa**
31. **Uwzględnienie inflacji w analizie wartości pieniądza w czasie**
32. **Rzeczywisty koszt długu – idea oraz sposób wyznaczania**
33. **Sposoby przenoszenia praw z papierów wartościowych**
34. **Manipulacja instrumentami finansowymi**
35. **Nadzór nad rynkiem inwestycyjnym na poziomie unijnym i krajowym**
36. **Komisja Nadzoru Finansowego – organizacja, zasady działania, uprawnienia**
37. **Wpływ czynników makroekonomicznych na rynki kapitałowe**
38. **Wpływ cykli gospodarczych na wyniki firm i sytuację na rynku**
39. **Niekonwencjonalne narzędzia polityki pieniężnej**
40. **Wpływ zmian kursu walutowego na zarządzanie portfelem**
41. **Mechanizm transmisji impulsów polityki pieniężnej**
42. **Metody wyceny składników aktywów i pasywów**
43. **Metody ustalania wyniku finansowego**
44. **Metody konsolidacji sprawozdań finansowych**
45. **I i II twierdzenie Millera i Modiglianiego w gospodarce z podatkami**
46. **Zawieranie i rozliczanie transakcji na rynkach finansowych**
47. **Główne rynki akcji i ich organizacja**
48. **Hipotezy efektywności rynku i ich implikacje**
49. **Źródła informacji o rynku - serwisy informacyjne, bazy danych, system ESPI**
50. **Ryzyko płynności w instytucjach kredytowych – rodzaje i prawne aspekty zarządzania tym ryzykiem**
51. **Ryzyko kredytowe w instytucjach kredytowych – rodzaje i prawne aspekty zarządzania tym ryzykiem**
52. **Ryzyko walutowe w instytucjach kredytowych – rodzaje i prawne aspekty zarządzania tym ryzykiem**
53. **Planowanie kapitałowe w instytucjach kredytowych - definicja i rodzaje funduszy własnych, mierniki efektywności finansowej i kosztowej oraz adekwatności kapitałowej**
54. **Teoria portfela Markowitza**
55. **Uproszczenie teorii portfela - modele wskaźnikowe**
56. **Model wyceny aktywów kapitałowych (CAPM)**
57. **Teoria arbitrażu cenowego (APT)**
58. **Podstawowe strategie zarządzania portfelem inwestycyjnym**
59. **Miary efektywności zarządzania portfelem inwestycyjnym**
60. **Model Blacka – Littermana i taktyczna alokacja aktywów**
61. **Portfel długoterminowy Campbella i Viceiry**

62. Portfel opcji

63. Wielokryterialna optymalizacja portfela – uwzględnianie zdolności aktywów do generowania ponadprzeciętnych stóp zwrotu