

Pytania do egzaminu dyplomowego
Studia II stopnia
Specjalność: DORADZTWO INWESTYCYJNE

1. Teoria użyteczności: klasy funkcji użyteczności i ich cechy
2. Model kapitalizacji dywidend (Williamsa - Gordona)
3. Metody mnożnikowe wyceny akcji i całej spółki
4. Wykorzystanie podejścia opcyjnego w wycenie kapitału własnego
5. Teorie i modele kształtowania się struktury stóp procentowych
6. Obligacje z opcjami dodatkowymi – typy opcji i zasady ich realizacji
7. Obligacje zabezpieczone aktywami: typy zabezpieczenia, charakterystyka przepływów pieniężnych, zasady wyceny obligacji
8. Wrażliwości obligacji z opcją na zmiany stóp procentowych
9. Obligacje hipoteczne – rodzaje i metody wyceny
10. Analiza rynkowej i ekonomicznej wartości dodanej w ramach analizy fundamentalnej
11. Cykl koniunkturalny i analizy międzyrynkowe w analizie technicznej
12. Podstawowe zasady pomiaru rynkowego Value at Risk.
13. Ryzyko kredytowe - scoring kredytowy i wartość zagrożona portfela kredytów.
14. Ryzyko operacyjne i operacyjny Value at Risk - sposoby pomiaru, podstawowe modele.
15. Ryzyko płynności i koncepcja Liquidity at Risk.
16. Testy wsteczne (backtests) i testy napięć (stress tests) w zarządzaniu ryzykiem finansowym.
17. Wybrane przestępstwa z zakresu działalności bankowej i ubezpieczeniowej - przeciwdziałanie praniu pieniędzy i finansowaniu terroryzmu
18. Konsekwencje karne realizowanych typów czynów zabronionych na rynkach finansowych
19. Prognozowanie kursu walutowego w długim i krótkim horyzoncie czasowym.
20. Analiza zdarzeń i jej wykorzystanie w empirycznych badaniach danych finansowych i ekonomicznych.
21. Analiza przyczynowości i sposób jej wykorzystania w badaniu zależności między procesami zachodzącymi w gospodarce i na rynkach finansowych.
22. Dynamiczne i statyczne modele czynnikowe w analizie danych ekonomicznych i finansowych
23. Kointegracja w wykrywaniu baniek spekulacyjnych na rynkach finansowych

- 24. Metody dochodowe wyceny przedsiębiorstwa z wyłączeniem modeli dywidendowych – analiza porównawcza**
- 25. Budowa i interpretacja wskaźników rynku kapitałowego spółek giełdowych**
- 26. Towarzystwa i fundusze inwestycyjne – aspekty prawno-organizacyjne**
- 27. Zasady opodatkowania na rynku finansowym**
- 28. Rodzaje opłat funduszy inwestycyjnych oraz zasady działania mechanizmu hurdle rate i high-water mark**
- 29. Fundusze rynku nieruchomości - rodzaje, zasady działania i zarządzania portfelem**
- 30. Metody inwestycji w spółki niepubliczne przez fundusze Private Equity/Venture Capital**