

Pytania do egzaminu dyplomowego
Studia II stopnia
Specjalność: DORADZTWO INWESTYCYJNE

1. Teoria portfela Markowitza.
2. Uproszczenie teorii portfela - modele wskaźnikowe.
3. Model wyceny aktywów kapitałowych (CAPM).
4. Teoria arbitrażu cenowego (APT).
5. Podstawowe strategie zarządzania portfelem inwestycyjnym.
6. Miary efektywności zarządzania portfelem inwestycyjnym.
7. Podstawowe typy transakcji fuzji i przejęć.
8. Taktyki obronne stosowane na etapie poprzedzającym wrogie przejęcie.
9. Motywy finansowe transakcji fuzji i przejęć.
10. Zasady tworzenia i podmioty zaangażowane w obsługę funduszy inwestycyjnych.
11. Funkcjonowanie funduszy inwestycyjnych: organy funduszu, tytuły uczestnictwa, ograniczenia inwestycyjne.
12. Otwarte fundusze emerytalne: istota, zasady działania.
13. Sposób oddziaływania stóp procentowych i kursu walutowego na inflację.
14. Miernik inflacji bazowej w procesie kształtowania polityki pieniężnej.
15. Rola luki PKB w polityce pieniężnej.
16. Hipoteza efektywności rynków w świetle finansów behawioralnych - podstawowe anomalie.
17. Porównaj teorię użyteczności i teorię perspektywy.
18. Heurystyki stosowane przez inwestorów na rynkach finansowych.
19. Funkcja użyteczności a cel inwestora - własności funkcji użyteczności.
20. Równoważnik pewności w teorii inwestowania - szacowanie i zastosowania.
21. Względna i bezwzględna awersja do ryzyka - idea, sposób obliczania, interpretacja i zastosowanie.
22. Prognozowanie kursu walutowego w długim i krótkim horyzoncie czasowym.
23. Analiza zdarzeń a stopy zwrotu z dowolnego instrumentu finansowego.
24. Analiza przyczynowości i sposób jej wykorzystania w badaniu zależności między procesami zachodzącymi w gospodarce i na rynkach finansowych.
25. Koncepcja ryzyka rynkowego i sposoby wyznaczania rynkowego Value at Risk.
26. Ryzyko kredytowe - zasady skoringu kredytowego i pomiar ryzyka portfela kredytowego banku.
27. Ryzyko operacyjne i metody jego szacowania.

28. Wycena obligacji dla losowej struktury terminowej stóp procentowych - modele dwustanowe.

29. Zasady sprawiedliwej wyceny kontraktów terminowych na stopę procentową.

30. Wycena instrumentów pochodnych stopy procentowej z wykorzystaniem modeli ciągłych.