

Szóbeli vizsgakérdések HALADÓ VÁLLALATI PÉNZÜGYBŐL

I. Tőkeköltségvetési döntések kockázatkezelése

1. A kockázat és bizonytalanság definiálása
2. Kockázatdiagnosztikai eszközök alkalmazása bizonytalanság esetén
3. Egytényezős érzékenység elemzés
4. Nyereségküszöb elemzés
5. Scenárió elemzés
6. Kockázatdiagnosztikai eszközök alkalmazása kockázat esetén
7. Döntési fa
8. Monte-Carlo szimuláció

II. Reálopciók

9. Az opció fogalma
10. Az opció tulajdonságai
11. Az egyszerű opciók nyereségfüggvényei
12. Az opció belső és időértéke
13. Az opciós díjat befolyásoló tényezők
14. Opciós ármodellek
15. Reálopció fogalma
16. Reálopciók főbb fajtái

III. Portfólió elmélet

17. Portfólió fogalma
18. Friedman portfólió elmélete
19. Hozamok fajtái
20. Két elemű portfólió hozama és kockázata
21. Egy portfólió kockázatosságának csökkentési lehetőségei
22. Részvényárra ható piaci tényezők
23. Részvényárra ható egyedi tényezők
24. CAPM lényege és feltételei