

Tájékoztató
BEFEKTETÉSI ÉS ÉRTÉKPAPÍRPIACI ISMERETEK (GTÜPZ114BL) című
tantárgyból a

Gazdaságtudományi Kar levelező tagozat
 pénzügy és számvitel alapszakos hallgatói részére
 2014/2015. tanév II. félév

Tantárgy neve: Befektetési és értékpapíri ismeretek		Tantárgy neptun kódja: GTÜPZ114BL
		Tantárgy jellege: K
Tantárgyfelelős neve, beosztása: Dr. Bozsik Sándor egyetemi docens		
Oktatásba bevont oktatók neve, beosztása: Süveges Gábor, tanársegéd		
Javasolt félév: 6T		Tárgyfelvétel előtanulmányi feltétele: Bankügyletek aláírás.
Óraszám (ea+gy): 9+6		Számonkérés módja: a-k
Kreditpont: 4		Tagozat: levelező
Tantárgy feladata és célja: A hallgatók a brókervizsga és az alapkezelői szakvizsga letételéhez szükséges alapismereteket szerzik meg, különös tekintettel az ehhez szükséges értékpapírmatematikára. A tantárgy foglalkozik a portfólióalkotás aktív és passzív módszereivel, a portfóliók teljesítménymérésével, a különböző fedezeti és arbitrázsügyletekkel. A hallgatók képesek lesznek a tőzsdén szereplő értékpapírok technikai elemzésére és a fundamentális elemzés alapjait is megismerik.		
Tantárgy leírása:		
Dátum	Időpont	Előadások és gyakorlatok tematikája
2015.02. 21.	09.00- 11.30	Technikai árfolyamelemzés I. (Vonaldiagram, O-X diagram, Japán-gyertya, Mozgóátlag) Technikai árfolyamelemzés II. (Bollinger-szalag, Fibonacci-sor, Elliott-hullám, Oscillátor, Momentum,)
2015.02. 21.	12.20- 14.50	Technikai árfolyamelemzés III. (Mozgóátlag, Weinstein, MACD, Pénzáram index, piacerősség) Vállalati érték meghatározás a benchmark módszerrel (P/E, Osztalékhozam, Kapitalizáció/Saját tőke) CAPM modell
2015.02. 21.	15.00- 17.30	Határidős ügyletek elszámolása, ügylettípusok Határidős ügyletek jellemzői, spekuláció elemi határidős ügyletekkel Spekuláció összetett határidős ügyletekkel I. (spreadek) Spekuláció összetett határidős ügyletekkel II. (kombinációk)
2015.04. 25.	09.00- 11.30	Arbitrázs I. – keresztárfolyamok, határidős egyensúlyi árak (tőzsdei áru, tőzsdei értékpapír) Arbitrázs II. - kamatláb és árfolyamra szóló futures egyensúlyi ára, bootstrap
2015.04. 25.	12.20- 14.50	Fedezeti ügyletek futuressal (futures mindenkori értékének meghatározása, swap értékelése, optimális fedezeti arány meghatározása, delta, béta jelentése) Opciók díja (binominális modell, Cox-Rubinstein, Black-Scholes model)- Hallgatói beadandók szóbeli prezentációja

Számonkérés módja:**Az aláírás megszerzése:**

Nincs.

A vizsgára bocsájtás feltétele:

Az előtanulmányi feltételben jelzett tantárgy(ak) teljesítése + az adott tantárgyból az aláírás megszerzése.

Gyakorlati jegy/kollokvium teljesítésének módja, értékelési szempontjai:

Csoportosan megírt és nyomtatott, illetve elektronikus formában leadott házi dolgozat. A dolgozatok terjedelme maximum 30 oldal! Maximum: 20 pont

A házi dolgozat pontos felépítése a tantárgy mappájában érhető el a honlapon. A házi dolgozat 11 ponttól elfogadható. A házi dolgozat pótlására az oktatóval egyeztetett időpontban van lehetőség.

Értékelése:

A vizsgaidőszakban írásbeli vizsgadolgozat megírása (tesztkérdések, kifejtős kérdések és számolási feladatok) Maximum 40 pont. Összpontszám: 60 pont.

0 - 60 pont (1) elégtelen; 31 - 37 pont (2) elégséges; 38 - 44 pont (3) közepes; 45 - 51 pont (4) jó; 52 - 60 pont (5) jeles

Kötelező irodalom:

1. Martin Hajdu György, May Réka (szerk) Tőzsdei Szakvizsga Felkészítő Közép-Európai Brókerképző Alapítvány 1998 Második rész: Tőzsdei szabályzatok Harmadik rész: Értékpapírszámtan Negyedik rész: Közgazdaságtan Kivéve: 408-458

Ajánlott irodalom:

1. Száz János: Tőzsdei opciók vételre és eladásra Tanszék Kft. 1999 ISBN: 9630383861
2. Malkiel Burton: Bolyongás a Wall Streeten Bankárképző 2001 ISBN: 9789630422420
3. Hull John: Options, futures and other derivatives Prentice Hall 2012 ISBN: 9780132164948
4. Kecskeméti István: Tőzsdei befektetés a technikai elemzés segítségével Kecskeméti Bt. 2006 ISBN: 9632298616
5. McDonald Robert: Derivative Markets Addison Wesley 2002 ISBN: 9780201729603

Miskolc, 2015. február 2.

Dr. Bozsik Sándor
egyetemi docens