

MISKOLCI EGYETEM

Gazdaságtudományi Kar

Üzleti Információgazdálkodási és Módszertani Intézet

Pénzügyi Intézeti Tanszék*Tájékoztató***TŐZSDEI ISMERETEK (GTÜPZ119B) című tantárgyból a**

Gazdaságtudományi Kar nappali tagozat

pénzügy és számvitel alapszakos hallgatói részére

2015/2016. tanév II. félév

Tantárgy neve: Tőzsdei ismeretek	Tantárgy neptun kódja: GTÜPZ119B
	Tantárgy jellege: K
Tantárgyfelelős neve, beosztása: Dr. Bozsik Sándor egyetemi docens	
Oktatásba bevont oktatók neve, beosztása: Süveges Gábor egyetemi tanársegéd, Gróf Pál egyetemi tanársegéd	
Javasolt félév: 6.T.	Tárgyfelvétel előtanulmányi feltétele: Pénzügytan legalább elégséges
Óraszám (ea+gy): 1+2	Számonkérés módja: A-K
Kreditpont: 4	Tagozat: nappali
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:

Naptári hét	Dátum	Előadások és gyakorlatok témája
6	2016.02.11	Technikai árfolyamelemzés I. (Vonaldiagram, O-X diagram, Japán-gyertya, Mozgóátlag)
7	2016.02.18	Technikai árfolyamelemzés II. (Bollinger-szalag, Fibonacci-sor, Elliott-hullám, Oscillátor, Momentum,)
8	2016.02.25	Technikai árfolyamelemzés III. (Mozgóátlag, Weinstein, MACD, Pénzáram index, piacerősség)
9	2016.03.03	Vállalati érték meghatározás a benchmark módszerrel (P/E, Osztalékhozam, Kapitalizáció/Saját tőke)
10	2016.03.10	Portfólióelmélet Markowitz-modell.
11	2016.03.17	CAPM modell
12	2016.03.24	Határidős ügyletek elszámolása, ügylettípusok
13	2016.03.31	ZH 1 Határidős ügyletek jellemzői, spekuláció elemi határidős ügyletekkel
14	2016.04.07	Spekuláció összetett határidős ügyletekkel I. (spreadek) Spekuláció összetett határidős ügyletekkel II. (kombinációk)
15	2016.04.14	Arbitrázs I. – keresztárfolyamok, határidős egyensúlyi árak (tőzsdei áru, tőzsdei értékpapír)
16	2016.04.21	Arbitrázs II. - kamatláb és árfolyamra szóló futures egyensúlyi ára, bootstrap – Hallgatói beadandók szóbeli prezentációja
17	2016.04.28	Fedezeti ügyletek futuressal (futures mindenkori értékének meghatározása, swap értékelése, optimális fedezeti arány meghatározása, delta, béta jelentése) - Hallgatói beadandók szóbeli preentációja
18	2016.05.05	ZH 2 Opciók díja (binominális modell, Cox-Rubinstein, Black-Scholes model)- Hallgatói beadandók szóbeli prezentációja
19	2016.05.12	Pótzh dolgozat, Elővizsga Hallgatók prezetnációi

Számonkérés módja:**Az aláírás megszerzése:**

szemináriumok 70%-n részvétel

A vizsgára bocsájtás feltétele:

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

Gyakorlati jegy/kollokvium teljesítésének módja, értékelési szempontjai:

A félév során a szemináriumokon 2 alkalommal írásbeli zárthelyi dolgozat kerül megírásra az előadásokon elhangzottakból. Felkészülni a tanszék honlapjára feltöltött PPT anyagokból és az elektronikus oktatási segédletből lehet. A dolgozatokkal megszerezhető pontok összege összesen 20 pont (2*10 pont). Pótlás az elővizsgahéten a szeminárium időpontjában!

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 a szorgalmi időszak utolsó előadásán van lehetőség.

Értékelése:

A vizsgaidőszakban írásbeli vizsgadolgozat megírása (tesztkérdések, kifejtős kérdések és számolási feladatok) Maximum 40 pont. Összpontszám: 80 pont.

0 - 40 pont (1) elégtelen; 41 - 50 pont (2) elégséges; 51 - 60 pont (3) közepes; 61 - 70 pont (4) jó; 71 - 80 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, 2016. január 31.

Dr. Bozsik Sándor
egyetemi docens