

MISKOLCI EGYETEM

Gazdaságtudományi Kar

Üzleti Információgazdálkodási és Módszertani Intézet

Pénzügyi Intézeti Tanszék**Tájékoztató****TŐZSDEI ISMERETEK (GTÜPZ119BL) című tantárgyból a**

Gazdaságtudományi Kar levelező tagozat

pénzügy és számvitel alapszakos hallgatói részére

2015/2016. tanév II. félév

Tantárgy neve: Tőzsdei ismeretek		Tantárgy neptun kódja: GTÜPZ119BL
		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): 6+9		Számonkérés módja: A-Gy
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 témája
2016.04.09.	12:20 – 14:50	Technikai árfolyamelemzés I. (Vonaldiagram, O-X diagram, Japán-gyertya, Mozgóátlag); Technikai árfolyamelemzés II. (Bollinger-szalag, Fibonacci-sor, Elliott-hullám, Oscillátor, Momentum,)
2016.04.15.	16:00 – 18:30	Technikai árfolyamelemzés III. (Mozgóátlag, Weinstein, MACD, Pénzáram index, piacerősség); Vállalati érték meghatározás a benchmark módszerrel (P/E, Osztalékhozam, Kapitalizáció/Saját tőke); CAPM modell
2016.04.22.	13:20 – 15:50	Határidős ügyletek elszámolása, ügylettípusok Határidős ügyletek jellemzői, spekuláció elemi határidős ügyletekkel Spekuláció összetett határidős ügyletekkel I. (spreadek) Spekuláció összetett határidős ügyletekkel II. (kombinációk) Arbitrázs I. – keresztárfolyamok, határidős egyensúlyi árak (tőzsdei áru, tőzsdei értékpapír)
2016.04.22.	16:00 – 18:30	Arbitrázs II. – kamatláb és árfolyamra szóló futures egyensúlyi ára, bootstrap; 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)
2016.04.30.	12:20 – 14:50	Hallgatói beadandók szóbeli prezentációja – Zárthelyi dolgozat megírása
A zárthelyi dolgozat és a pót zárthelyi dolgozat megírásának pontos időpontja az első foglalkozás alkalmával kerül megbeszélésre.		

Számonkérés módja:**Az aláírás megszerzése:**

Nincs.

A vizsgára bocsátás feltétele:

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

Gyakorlati jegy/kollokvium teljesítésének módja, értékelési szempontjai:

A féléves teljesítmény értékelése két részből tevődik össze:

- Csoportosan megírt és elektronikus formában leadott házi dolgozat, melynek témája egy tőzsdén jegyzett vállalkozás részvényeinek technikai és fundamentális elemzése. A dolgozat terjedelme legfeljebb 30 oldal. A házi dolgozat prezentációjára az utolsó foglalkozáson kerül sor. Pótlásra az oktatóval egyeztetett időpontban van lehetőség. A megszerzhető maximális pontszám: 20 pont. A házi dolgozat 11 ponttól elfogadható.
- Félév végén megírt zárthelyi dolgozat (tesztkérdések, kifejtős kérdések és számolási feladatok). A megszerzhető maximális pontszám: 40 pont.

Értékelése:

Összpontszám: 60 pont.

0-60 pont (1) elégtelen; 31-37 pont (2) elégséges; 38-44pont (3) közepes; 45-51pont (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, 2016. február 1.

Dr. Bozsik Sándor
egyetemi docens