Pénzügyi befektetések tervezése

vizsgatematika

1. Részvény, kötvény, váltó, Portfolió diverzifikáció. Markovitz elmélet, optimális portfolió (1-3 fejezet)
2. A rizikó fogalma, szisztematikus és specifikus rizikó, A tőkepiaci árfolyamok modellje (CAPM). Feltevések, tétel (4. fejezet)
3. Log-optimális portfólió-stratégiák log-optimalitás,
   1. Diszkrét emlékezet nélküli folyamatok
4. Log-optimális portfólió-stratégiák illetve stacionárius folyamatok
   1. folytonos értékű folyamatok, árfolyamatok
5. Opció fogalma, arbitrázs, Opciók árazása. Egylépéses modell ( 7.1-7.5.1. fejezet)
6. Több periódus, a binomiális modell CRR képlet, Put-cal paritás ( 7.6-7.7.1. fejezet)
7. CRR 🡪 B-S formula A formula paraméterei és értelmezése, mi hogy változtatja az árat ( 7.8 fejezet )
8. A feltételes várható érték ( 8. fejezet)
9. Általános diszkét piaci modell, árrendszer, ármérce, értékfolyamat ( 9.1-9.1.4. fejezet)
10. Önfinanszírozó stratégia, megengedett stratégia, No Arbitrázs  egy ár tétele ( 9.1.5-9.1.8. fejezet)
11. Az arbitrázs árazás martingál mértéke ( 9.2 fejezet)
12. Az opció árazás alaptétel kimondása, értelmezése