

Математичні моделі фінансових ринків

Запитання до іспиту

1. Класифікація фінансових ринків: валютний ринок
2. Класифікація фінансових ринків: грошовий ринок
3. Класифікація фінансових ринків: ринок облігацій
4. Класифікація фінансових ринків: фондовий ринок
5. Інструменти фінансових ринків: інструменти з готівкою
6. Інструменти фінансових ринків: похідні інструменти (деривативи)
7. Види процентної ставки – простий, складний та безперервний відсоток
8. Грошові потоки: чиста приведена вартість (NPV) потоку інвестицій
9. Грошові потоки: чиста ефективна прибутковість за базовий період
10. Інвестиційний горизонт
11. Показники вартості грошових потоків та їх застосування
12. Імунізація грошового потоку
13. Оптимізація грошового потоку
14. Визначення курсової вартості купонної облігації
15. Визначення прибутковості облігації
16. Визначення прибутків від облігації: реалізований відсоток
17. Визначення ціни та прибутковості облігації з урахуванням податкових та комісійних платежів
18. Дюрація облігації
19. Вигин облігації
20. Визначення курсової вартості акції
21. Визначення прибутковості акції
22. Визначення курсової вартості та прибутковості векселю
23. Визначення курсової вартості та прибутковості банківських сертифікатів
24. Форми кривої прибутковості
25. Теорії часової структури процентних ставок: теорія чистих очікувань
26. Теорії часової структури процентних ставок: теорія переваги ліквідності
27. Теорії часової структури процентних ставок: теорія сегментації ринку
28. Технічний аналіз
29. Фундаментальний аналіз
30. Загальна характеристика опціонних контрактів: опціон колл
31. Загальна характеристика опціонних контрактів: опціон пут
32. Категорії опціонів
33. Опціонні стратегії
34. Границі премії опціонів на акції, за якими не виплачуються дивіденди
35. Моделі визначення премії опціонів: модель Блека-Шоулза
36. Моделі визначення премії опціонів: модель біноміальна модель
37. Хеджування за допомогою опціонів
38. Варранти: загальна характеристика та вартість
39. Очікувана прибутковість портфелю фінансових активів

40. Очікуваний ризик портфелю фінансових активів
41. Ризик портфелю, що складається з двох корельованих активів
42. Домінуючий портфель з двох активів
43. Портфель, що складається з активу без ризику та ризикованого активу
44. Кредитний та позиковий портфелі
45. Ефективна границя портфелів, що складаються з активу без ризику та ризикованого активу
46. Теорема відділення
47. Ефективна границя при різних ставках по позиках та депозитах
48. Модель оцінки вартості активів: CAPM-модель
49. Лінія ринку капіталу: SML
50. Ринковий та неринковий ризики. Ефект диверсифікації
51. Визначення індексу бета
52. Лінія ринку активу: CML
53. Визначення індексу альфа
54. Модифікації CAPM-моделі
55. Модель Шарпа
56. Зв'язок між CAPM-моделлю та моделлю Шарпа