KURZUS FELÉPÍTÉSE /
A Monte Carlo szimuláció használata pénzügyi elemzésekben

MODUL 1. (1. alkalom)

törzsrész

- **véletlenszám generálás** (egyenletes, normális, binomiális)
- Fix kamatozású vs változó *kamatozású* hitelek és betétek (kamatswap, változó kamatozású betét)
- hisztogram készítés
- átlag és szórás számítás
- **VBA függvények írása** (képletírás, ciklus, IF utasítás)

opcionális

- készletszimuláció

MODUL 2. (2. alkalom)

törzsrész

- Az eszközarányos árbevétel és az árbevétel arányos nyereség ingadozásainak hatása a részvényesek és hitelezők jövedelmére eltérő eladósodottsági szintek mellett
- Az utolérés esélye a *kockadobásos* társasjátéknál
- **árfolyamalakulás szimulációja, a jövőbeni árfolyam eloszlása**

opcionális

- lognormális eloszlás
- hol állunk 5 kockadobás után a társasjátékban?

A kurzustartalommal kapcsolatos változás jogát fenntartjuk!

MODUL 3. (3. alkalom)

törzsrész

- kötvényportfólió pénzáramlása (CF)
- **korreláció** számítása, kételemű részvényportfólió alakulásának szimulációja

opcionális

- kötvényportfólió CF-nak és IRR-jének alakulása adott hozamgörbe mellett
- exponenciális eloszlású véletlenszámok
- kiszolgálási rendszer szimuláció

MODUL 4. (4. alkalom)

törzsrész

- **mintaelemszám, a becslés pontossága és megbízhatósága**
- határidős árfolyam alakulásának szimulációja
- beruházás, termelés, árbevétel szimuláció, az *eladósodottság* alakulása

opcionális

- mi a valószínűsége, hogy nyerünk egy határidős ügyleten, várhatóan mennyit nyerünk, ha nyerünk?
- a kiírt opciós pozíció fedezésének szimulációja

A kurzustartalommal kapcsolatos változás jogát fenntartjuk!