

Sylabus przedmiotu

Przedmiot:	Wstęp do matematyki finansowej
Kierunek:	Matematyka (specjalności nauczycielskie), II stopień [4 sem], stacjonarny, ogólnoakademicki, rozpoczęty w: 2013
Rok/Semestr:	II/4
Liczba godzin:	15,0
Nauczyciel:	Kwaśnik Katarzyna, mgr
Forma zajęć:	laboratorium
Rodzaj zaliczenia:	zaliczenie na ocenę
Poziom trudności:	nie dotyczy
Metody dydaktyczne:	• ćwiczenia laboratoryjne
Zakres tematów:	1. Wycena podstawowych papierów wartościowych. Weksle, bony skarbowe, obligacje. Akcje. Portfele papierów wartościowych. 2. Wprowadzenie do instrumentów pochodnych. Kontrakty forward i futures. Kontrakty FRA. Kontrakty wymiany stóp procentowych (swap). Opcje europejskie i amerykańskie. Parytet kupna i sprzedaży. Wycena opcji na akcję na przykładach modelu dwumianowego i modelu Blacka-Scholesa. Hedging: delta, gamma, wega.
Forma oceniania:	• obecność na zajęciach • ocena ciągła (bieżące przygotowanie do zajęć i aktywność) • śródsesestralne pisemne testy kontrolne
Literatura:	1. M. Dobija, E. Smaga, Podstawy matematyki finansowej i ubezpieczeniowej, PWN, 1996. 2. J. C. Hull, Futures, options and other derivatives, wyd. 6, Prentice Hall, 2005. 3. M. Podgórska, J. Klimkowska, Matematyka finansowa, PWN, 2005 4. A. Weron, R. Weron, Inżynieria finansowa, WNT, 1998.
Dodatkowe informacje:	Dodatkowe informacje znajdują się na stronie Instytutu Matematyki