

Sylabus przedmiotu

Przedmiot:	Wstęp do matematyki finansowej
Kierunek:	Matematyka (specjalności nauczycielskie), II stopień [4 sem], niestacjonarny, ogólnoakademicki, rozpoczęty w: 2013
Rok/Semestr:	I/2
Liczba godzin:	18,0
Nauczyciel:	Pawlas Piotr, dr hab.
Forma zajęć:	wykład
Rodzaj zaliczenia:	egzamin
Punkty ECTS:	2,0
Godzinowe ekwiwalenty punktów ECTS (łącznie liczba godzin w semestrze):	3,0 Godziny kontaktowe z prowadzącym zajęcia realizowane w formie konsultacji 27,0 Godziny kontaktowe z prowadzącym zajęcia realizowane w formie zajęć dydaktycznych 13,5 Przygotowanie się studenta do zajęć dydaktycznych 13,5 Przygotowanie się studenta do zaliczeń i/lub egzaminów 3,0 Studiowanie przez studenta literatury przedmiotu
Poziom trudności:	nie dotyczy
Metody dydaktyczne:	<ul style="list-style-type: none"> • objaśnienie lub wyjaśnienie • wykład informacyjny
Zakres tematów:	<p>1. Wycena podstawowych papierów wartościowych. Weksle, bony skarbowe, obligacje. Akcje. Portfele papierów wartościowych.</p> <p>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.</p>
Forma oceniania:	<ul style="list-style-type: none"> • egzamin pisemny
Literatura:	<ol style="list-style-type: none"> 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