

**KAPITAŁ LUDZKI**
NARODOWA STRATEGIA SPÓJNOŚCIProjekt współfinansowany przez
Unię Europejską w ramach
Europejskiego Funduszu
Społecznego**UNIA EUROPEJSKA**
EUROPEJSKI
FUNDUSZ SPOŁECZNY

Nazwa przedmiotu		Kod ECTS	
Seminarium magisterskie: Wycena instrumentów finansowych		11.1.0287	
Nazwa jednostki prowadzącej przedmiot			
Instytut Matematyki			
Studia			
wydział	kierunek	poziom	drugiego stopnia
Wydział Matematyki, Fizyki i Informatyki	Matematyka	forma	stacjonarne
		moduł	matematyka teoretyczna, matematyka nauczycielska, matematyka
		specjalnościowy	stosowana, matematyka finansowa
		specjalizacja	wszystkie
Nazwisko osoby prowadzącej (osób prowadzących)			
prof. UG, dr hab. Henryk Leszczyński			
Formy zajęć, sposób ich realizacji i przypisana im liczba godzin		Liczba punktów ECTS	
Formy zajęć		24	
Seminarium			
Sposób realizacji zajęć			
zajęcia w sali dydaktycznej			
Liczba godzin			
Seminarium: 120 godz.			
Cykl dydaktyczny			
2016/2017 zimowy, 2016/2017 letni, 2017/2018 zimowy, 2017/2018 letni			
Status przedmiotu		Język wykładowy	
fakultatywny (do wyboru)		polski	
Metody dydaktyczne		Forma i sposób zaliczenia oraz podstawowe kryteria oceny lub wymagania egzaminacyjne	
Analiza tekstów z dyskusją		Sposób zaliczenia	
		- Zaliczenie na ocenę - Zaliczenie (zal)	
		Formy zaliczenia	
		wykonanie pracy zaliczeniowej - projekt lub prezentacja	
		Podstawowe kryteria oceny	
Sposób weryfikacji założonych efektów kształcenia			

zakładany efekt kształcenia	Referat	Obserwacja postawy studenta	Aktywność w dyskusji
Wiedza			
K_W03	+		
K_W07			+
Umiejętności			
K_U02	+		
K_U03	+		
K_U04	+		
K_U05	+		
K_U07			+
K_U08	+		
K_U09	+		
Kompetencje			
K_K01		+	
K_K02			+
K_K04		+	
K_K05	+		
K_K06			+
K_K07		+	

Określenie przedmiotów wprowadzających wraz z wymogami wstępnymi**A. Wymagania formalne**

Referat na seminarium, aktywność, frekwencja i około 3 stronicowy opis referatu.

B. Wymagania wstępne**Cele kształcenia**

celem jest przygotowanie studentów do pisania pracy magisterskiej

Treści programowe

1. Teoria arbitrażu.
2. Modele rynku zupełnego.
3. Relacja preferencji.
4. Optymalność i równowaga.
5. Monetarne miary ryzyka.
6. Dynamiczna teoria arbitrażu.
7. Opcje europejskie.
8. Strategie zatrzymania dla kupującego i sprzedającego.
9. Obwiednia Snella.
10. Ceny wolne od arbitrażu.

Wykaz literatury

1. H. Folmer, A. Schied "Stochastic Finance. An Introduction in Discrete Time", DeGruyter, 2011.
2. S. R. Pliska "Wprowadzenie do matematyki finansowej Modele z czasem dyskretnym" WNT2005.
3. P. J. Hunt, J. E. Kennedy, "Financial derivatives in theory and practice" Wiley 2004.
4. J. Jakubowski et al, "Matematyka finansowa. Instrumenty pochodne", WNT 2003.

Efekty kształcenia (obszarowe i kierunkowe)**Wiedza**

- Student ma pogłębioną wiedzę teoretyczną na temat wyników i argumentowania w dziedzinie wyceny instrumentów finansowych i narzędzi matematycznych związanych z tą wyceną. Poznał w szczególności pojęcia arbitrażu, rynku zupełnego i miary ryzyka. Nabył doświadczenie w rozumieniu dowodów i osobistym dowodzeniu przez przedstawianie takich dowodów grupie. (K_W03)
- Student zdobywa wiedzę na temat prawa autorskiego i własności intelektualnej (K_W07).

Umiejętności

- Student nabywa umiejętności rozumienia tekstów matematycznych w dziedzinie wyceny instrumentów finansowych na zaawansowanym poziomie. (K_U03, K_U04)
- Student potrafi stosować metody probabilistyczne w argumentacji matematycznej, rozwiązywaniu elementarnych zagadnień i przeprowadzaniu dowodów, w mowie i w piśmie. (K_U04, K_U05)
- Student nabywa umiejętności wyrażania treści matematycznych w mowie i w piśmie i potrafi określić swoje zainteresowania w matematycznych dyskusjach. Ma osiągnąć poziom taki, aby był w stanie rozumieć wykłady przeznaczone dla młodych matematyków. (K_U02, K_U07)
- Student umie przygotować wystąpienia ustne, potrafi przygotować referat i przeprowadzić jego prezentację na zadany temat, i jest również w stanie przygotować odpowiednie teksty w formie pisemnej. (K_U08, K_U09)

Kompetencje społeczne (postawy)

- Student potrafi samodzielnie wyszukiwać informacje w literaturze fachowej (również w czasopiśmie matematycznych i sprawozdaniach z konferencji), przygotowując wystąpienia przed grupą. (K_K05)
- Student poznaje ograniczenia własnej wiedzy spotykając się z zaawansowaną matematyką, dowiadując się o wynikach, które są zbyt trudne, aby przedstawić je z dowodami na zajęciach. (K_K01)
- Ponadto aktywnie uczestniczy w seminarium i potrafi formułować pytania służące pogłębieniu własnego rozumienia danego tematu lub odnalezieniu brakujących elementów rozumowania. (K_K02)
- Potrafi formułować opinie na temat podstawowych zagadnień matematycznych. (K_K06)
- Student rozumie i docenia znaczenie uczciwości intelektualnej w działaniach własnych i innych osób; postępuje etycznie. (K_K04)
- Potrafi myśleć i działać w sposób przedsiębiorczy. (K_K07)

Kontakt

Henryk.Leszczynski@mat.ug.edu.pl