

Nazwa przedmiotu:	ANALIZA INSTRUMENTÓW POCHODNYCH I STRUKTURYZOWANYCH			
Forma: Wykład	Godzin: 15 Semestr: 2 Rok: I	Forma zaliczenie: zal. na ocenę	ECTS 3	
Wydział: ZIF	Kierunek: Finanse i Rachunkowość	Tryb: stacjonarny Rodzaj: II stopień		
Specjalność: Analityk finansowy i zarządzanie ryzykiem				
Tytuł, stopień	Imię i nazwisko lub nazwa katedry	e-mail	telefon	Pok/bud
dr	Paweł Rokita	pawel.rokita@ue.wroc.pl	713680338	307Z

1. Wymagania wstępne

Matematyka finansów, zarządzanie ryzykiem, instrumenty finansowe

2. Program przedmiotu

Matematyczne podstawy modelu wyceny instrumentów pochodnych na akcje (procesy Ito, lemat Ito, koncepcja wyprowadzenia funkcji wyceny Blacka-Scholesa), matematyczne podstawy wyceny instrumentów pochodnych na stopę procentową (modele dynamiki stopy procentowej i struktury terminowej oraz ich zastosowanie w wycenie instrumentów pochodnych), wycena obligacji z wbudowanymi opcjami, przegląd opcji egzotycznych, elementy analizy opcji egzotycznych, produkty strukturyzowane (rodzaje, cele, elementy analizy), kredytowe instrumenty pochodne.

3. Metodyka zajęć

Wykład + ćwiczenia

4. Cel dydaktyczny przedmiotu

Wiadomości: podstawy teoretyczne wyceny instrumentów pochodnych na akcje, stopę procentową oraz kredytowych instrumentów pochodnych, znajomość podstawowych opcji egzotycznych, kredytowych instrumentów pochodnych i produktów strukturyzowanych.

Umiejętności: ocena możliwości, zasadności i potencjalnych skutków wykorzystania zaawansowanych instrumentów pochodnych i strukturyzowanych w celach inwestycyjnych, spekulacyjnych oraz do zarządzania ryzykiem

Wykaz literatury podstawowej (do 4 pozycji)

- Pruchnicka-Grabias I. (2010): Egzotyczne opcje finansowe : systematyka, wycena, strategie. CeDeWu.
 Kasapi A. (2001): Kredytowe instrumenty pochodne : charakterystyka, rodzaje i zasady obrotu. Oficyna Ekonomiczna
 Zaremba A. (2009): Produkty strukturyzowane : inwestycje nowych czasów. Helion
 Hull J. (2000): Options, futures and other derivative securities. Prentice Hall.

Wykaz literatury uzupełniającej (do 4 pozycji)

- Blümke A. (2009): How to invest in structured products : a guide for investors and investment advisors. Wiley.
 Das S. (2006): Structured products. Vol.1, Vol.2. Wiley.
 Tan Ch.Ch (2010): Demystifying Exotic Products. Wiley.
 Wystup Uwe (2006): FX Options and Structured Products. Wiley.