

Nazwa przedmiotu:	ANALIZA INSTRUMENTÓW POCHODNYCH I STRUKTURYZOWANYCH			
Forma: Ćwiczenia	Godzin: 15 Semestr: 2 Rok: I	Forma zaliczenie: zal. na ocenę	ECTS	
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 Porcenałuk	pawel.porcenaluk@ue.wroc.pl	80338	307Z

1. Wymagania wstępne

Finanse, Matematyka finansowa

2. Program przedmiotu

Instrumenty wolne od ryzyka - rodzaje, analiza i wycena. Opcje na rynku finansowym - rodzaje opcji na rynku giełdowym i pozagiełdowym, analiza i wycena (modele ciągłe i dyskretne wyceny opcji waniliowych i egzotycznych), czynniki wpływające na wartość opcji, miary wrażliwości. Łączenie poznanych instrumentów do budowy produktów strukturyzowanych - rodzaje produktów strukturyzowanych, analiza i wycena, formuły wypłat, zagadnienie marży, problem ochrony (gwarancji) kapitału, wskaźnik partycypacji tj. udziału w zysku, opcje wbudowane w produkt strukturyzowany np. funkcja autocall.

3. Metodyka zajęć

Rozwiązywanie zadań teoretycznych oraz analiza przypadków z praktyki rynku.

4. Cel dydaktyczny przedmiotu

Wiadomości: narzędzia i metody stosowane w analizie instrumentów pochodnych oraz produktów strukturyzowanych.

Umiejętności: wycena i analiza konkretnych instrumentów pochodnych i produktów strukturyzowanych, budowanie strategii inwestycyjnych.

Wykaz literatury podstawowej (do 4 pozycji)

- Hull J.: Kontrakty terminowe i opcje - wprowadzenie. WIG-Press, 1998
- Weron A., Weron R.: Inżynieria finansowa - wycena instrumentów pochodnych, symulacje komputerowe, statystyka rynku. Wydawnictwa Naukowo Techniczne, 2009
- Jajuga K., Jajuga T.: Inwestycje: instrumenty finansowe, aktywa niefinansowe, ryzyko finansowe, inżynieria finansowa. Wydawnictwo Naukowe PWN, 2009

Wykaz literatury uzupełniającej (do 4 pozycji)

- Zaremba A.: Produkty strukturyzowane - inwestycje nowych czasów. Wydawnictwo Helion, 2008