

Rok akademicki:	Grupa przedmiotów	Numer katalogowy:		INF401
Nazwa przedmiotu ¹⁾ :	Opcje egzotyczne		ECTS ²⁾	2
Tłumaczenie nazwy na jęz. angielski ³⁾ :	Exotic options			
Kierunek studiów ⁴⁾ :	Finanse i Rachunkowość			
Koordynator przedmiotu ⁵⁾ :	dr Monika Krawiec			
Prowadzący zajęcia ⁶⁾ :	dr Monika Krawiec			
Jednostka realizująca ⁷⁾ :	Wydział Zastosowań Informatyki i Matematyki, Katedra Ekonometrii i Statystyki			
Wydział, dla którego przedmiot jest realizowany ⁸⁾ :	Wydział Nauk Ekonomicznych			
Status przedmiotu ⁹⁾ :	a) przedmiot	b) stopień	c) rok	d) forma studiów
	SW	2	2	stacjonarne / niestacjonarne
Cykl dydaktyczny ¹⁰⁾ :	a) semestr		b) Jęz. wykładowy ¹¹⁾	
	4		polski	
Założenia i cele przedmiotu ¹²⁾ :	Celem przedmiotu jest: - zapoznanie studentów z niestandardowymi kontraktami opcyjnymi - przedstawienie ich charakterystycznych własności - omówienie metod ich wyceny - analiza efektywności zastosowania poszczególnych instrumentów w odmiennych warunkach rynkowych			
Formy dydaktyczne, liczba godzin ¹³⁾ :	a) forma dydaktyczna		b) liczba godzin (stacjonarne i niestacjonarne)	
	a1) wykład		20	12
	a2) ćwiczenia audytoryjne			
	a3) ćwiczenia laboratoryjne		10	6
Metody dydaktyczne ¹⁴⁾ :	dyskusja	T	eksperyment	
	projekt badawczy		studium przypadku	
	rozwiązywanie problemu	T	gry symulacyjne	
	analiza i interpretacja tekstów źródłowych		indywidualne projekty studenckie	
	konsultacje	T	inne ...	
	inne...		inne ...	
	inne...		inne ...	
Pełny opis przedmiotu ¹⁵⁾ :	A. wykłady Geneza i taksonomia opcji egzotycznych, charakterystyka i metody wyceny: opcji zależnych od trajektorii (opcji barierowych, azjatyckich i wstecznych), opcji zależnych od czasu (opcji wyboru i opcji forward start), opcji binarnych (gotówka-albo-nic, walor-albo-nic, gap i supershare), opcji wieloczynnikowych (wymiany, koszykowych, tęczowych).			
	B. ćwiczenia Przygotowanie parametrów do wyceny opcji egzotycznych, wycena poszczególnych typów opcji egzotycznych, wyznaczenie ich profilu wypłaty, analiza efektywności zastosowania poszczególnych opcji egzotycznych w odmiennych warunkach rynkowych.			
Wymagania formalne (przedmioty wprowadzające) ¹⁶⁾ :	Inżynieria finansowa			
Założenia wstępne ¹⁷⁾ :	podstawowa wiedza z zakresu matematyki i statystyki oraz finansów			

Efekty kształcenia ¹⁸⁾ : (z kolejnymi numerami, 01, 02, 03 itd.)	01 - student zna podstawowe opcje egzotyczne		05 -	
	02 - potrafi je wycenić i wykreślić profil wypłaty		06 -	
	03 - umie skonstruować niestandardowe kontrakty opcyjne		07 -	
	04 - potrafi ocenić efektywność decyzji o wykonaniu kontraktu na podstawie profilu wypłaty		08 -	
Sposób weryfikacji efektów kształcenia ¹⁹⁾ :	kolokwium na zajęciach ćwiczeniowych	01, 02, 03, 04	ocena wykonanie zadania projektowego na zdefiniowany temat	
	praca pisemna przygotowywana w ramach pracy własnej studenta		ocena wynikająca z obserwacji w trakcie zajęć	
	ocena eksperymentów wykonywanych w trakcie zajęć		przygotowanie zespołowej analizy zdefiniowanego problemu	
	ocena wystąpień i prezentacji w trakcie zajęć		obserwacja w trakcie dyskusji zdefiniowanego problemu (aktywność)	
	egzamin pisemny		test komputerowy	
	egzamin ustny		inne..	
	inne...		inne..	
Forma dokumentacji osiągniętych efektów kształcenia ²⁰⁾ :	okresowe prace pisemne		imiennie karty oceny studenta	
	złożone projekty		treść pytań egzaminacyjnych z oceną	
	inne...		inne..	
	inne...		inne..	
Elementy i wagi mające wpływ na ocenę końcową ²¹⁾ :	Element oceny	Waga w %	Element oceny	Waga w %
	kolokwium na zajęciach ćwiczeniowych	100%	ocena wykonania zadania projektowego na zdefiniowany temat	
	praca pisemna przygotowywana w ramach pracy własnej studenta		ocena wynikająca z obserwacji w trakcie zajęć	
	ocena eksperymentów wykonywanych w trakcie zajęć		przygotowanie zespołowej analizy zdefiniowanego problemu	
	ocena wystąpień i prezentacji w trakcie zajęć		obserwacja w trakcie dyskusji zdefiniowanego problemu (aktywność)	
	egzamin pisemny		test	
	egzamin ustny		inne..	
inne...		inne..		
Miejsce realizacji zajęć ²²⁾ :	Wykład i ćwiczenia: laboratorium komputerowe			
Literatura podstawowa i uzupełniająca ²³⁾ :				
a) podstawowa				
1. Krawiec, M. 2007. Zastosowania instrumentów pochodnych do ograniczania ryzyka rynkowego. Wyd. SGGW, Warszawa.				
2. Pruchnicka-Grabias, I. 2006. Finansowe opcje egzotyczne. Wyd. CeDeWu, Warszawa.				
b) uzupełniająca				
3. Weron, A., Weron, R. 2005. Inżynieria finansowa. WNT.				
4.				
5.				
6.				
7.				
8.				
UWAGI ²⁴⁾ :				