

SYLABUS PRZEDMIOTU
rok akademicki 2013/2014

Elementy składowe sylabusu	Opis
Nazwa przedmiotu	Wprowadzenie do modeli finansowych z czasem dyskretnym. .
Kod przedmiotu	
Nazwa kierunku	Kierunek matematyka studia stopnia I ^o , specjalność matematyka finansowa.
Nazwa jednostki prowadzącej kierunek	Wydział Matematyki i Informatyki (Instytut Matematyki)
Język przedmiotu	Polski
Charakterystyka przedmiotu	Treści kształcenia przedmiot do wyboru. Wykład monograficzny.
Rok studiów/ semestr	Rok III semestr V.
Liczba godzin zajęć dydaktycznych oraz forma prowadzenia zajęć	30 godzin wykładu i 30 godzin laboratorium
Punkty ECTS	
Prowadzący	<i>dr Jarosław Kotowicz</i>
Założenia i cele przedmiotu	Celem wykładu jest przedstawienie podstaw modelowania cen instrumentów finansowych oraz konsumpcji i inwestycji dla czasu dyskretnego.
Wymagania wstępne	<i>Rachunek prawdopodobieństwa I, Badania operacyjne.</i>
Treści merytoryczne przedmiotu	<ol style="list-style-type: none"> 1. Jednookresowe modele rynku instrumentów finansowych. 2. Wielookresowe modele rynku instrumentów finansowych. 3. Inwestycje i konsumpcja oraz wybór optymalnej konsumpcji i inwestycji. 4. Opcje i inne instrumenty oraz ich wycena.
Forma i warunki zaliczenia przedmiotu	<p>Przedmiot kończy się egzaminem.</p> <p>Laboratorium:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Na laboratorium przewidziane są następujące prace pisemne: <ul style="list-style-type: none"> • kolokwia, za które można otrzymać łącznie 80 punktów, • prace domowe, za które można otrzymać łącznie 20 punktów. <ol style="list-style-type: none"> a. Każda z prac pisemnych w danej grupie prac jest punktowana jednakowo. Prowadzący laboratorium może każdą z prac pisemnych oceniać we właściwej dla niej skali punktowej z tym, że liczba uzyskanych punktów zostaje przeliczona na liczbę punktów wskazaną w sylabusie z dokładności do dwóch miejsc po przecinku. b. Prowadzący laboratorium wyznacza dwa terminy każdego kolokwium: termin I i termin II. Student, który przystąpił w terminie I do kolokwium i go nie zaliczył może, za zgodą prowadzącego, przystąpić do tego kolokwium w terminie II. c. Prowadzący laboratorium może dla studentów, którzy zaliczyli tylko jedno kolokwium, przeprowadzić na koniec semestru kolokwium zaliczające (ratunkowe). d. Każdą pracę domową należy oddać prowadzącemu w ciągu dwóch tygodni od jej zadania (w przypadku końca semestru termin ten może ulec skróceniu do 1 tygodnia). W przypadku, gdy ostatni dzień terminu oddania pracy domowej przypada w dzień wolny od zajęć dydaktycznych, pracę domową należy oddać w pierwszym dniu zajęć dydaktycznych bezpośrednio następującym po tym dniu. Prace oddane po terminie nie są brane pod uwagę. 2. Podstawą do zwolnienia studenta z uczestnictwa w części lub całości laboratorium może być <ul style="list-style-type: none"> • uzyskanie zgody dziekana na IOS, o ile przedmiot nie znalazł się w wykazie przedmiotów, na które student ma obowiązek uczestniczyć, • realizacji przez studenta ITS, • kolizji zajęć z powodu studiów na dwóch kierunkach,

- kolizji zajęć z powodu powtarzania przedmiotu.

Zgodę na zwolnienie z laboratorium udziela prowadzący to laboratorium w ciągu 30 dni od rozpoczęcia semestru w przypadku IOS oraz w ciągu 7 dni od rozpoczęcia semestru w pozostałych przypadkach, informując o tym prowadzącego wykłady. Uzyskanie zgody na zwolnienie z laboratorium nie jest możliwe po upływie terminu wskazanego w zdaniu poprzednim.

3. Opuszczenie przez studenta 20% zajęć laboratoryjnych przewidzianych planem stanowi podstawę do ich niezaliczenia (§22 *Regulaminu Studiów UwB*). Student taki może uzyskać zaliczenie laboratorium, jeżeli wynika to z liczby punktów uzyskanych z kolokwiów.
4. Prowadzący laboratorium wystawia ocenę końcową zgodnie z określoną na końcu skalą ocen, z zastrzeżeniem, że
 - a. niezaliczenie wszystkich kolokwiów, bądź przystąpienie i niezaliczenie kolokwium ratunkowego oznacza uzyskanie oceny niedostatecznej z laboratorium,
 - b. prowadzący laboratorium może podnieść ocenę końcową o pół stopnia w przypadkach, gdy student
 - zaliczył każde kolokwium w pierwszym terminie wskazanym przez prowadzącego,
 - wykazywał się aktywnością na zajęciach w laboratorium.Łącznie końcowa ocena z laboratorium może być podwyższona o co najwyżej jeden stopień.

Wykład:

1. Do egzaminu dopuszczony jest student, który uzyskał zaliczenie laboratorium.
2. Na wykładzie przewidziane są kartkówki, za które można otrzymać łącznie 20 punktów.

Punktowanie i zaliczanie prac pisemnych odbywa się zgodnie z zasadami obowiązującymi przy zaliczaniu ćwiczeń z tym, że w przypadku spóźnienia lub nieobecności na wykładzie, na którym była kartkówka studentowi uzyskuje za nią 0 punktów.

3. Egzamin odbywa się w formie pisemnej i składa się z dwóch części:
 - część praktyczna
 - część teoretyczna.
4. Student może uzyskać łącznie 60 punktów. Każdą z części egzaminu prowadzący ocenia we właściwej dla niej skali punktowej, z tym że ostateczny wynik przeliczana na określoną powyżej punktację z dokładnością do dwóch miejsc po przecinku.
5. Istnieje możliwość zwolnienia części teoretycznej i praktycznej. Ze zwolnienia może skorzystać student, który nie ściągał na kolokwiach i kartkówkach.
 - Ze zwolnienia z części praktycznej może skorzystać student, który uzyskał co najmniej 75% punktów z kolokwiów na laboratorium.
 - Ze zwolnienia z części teoretycznej może skorzystać student, który uzyskał co najmniej 75% punktów z kartówek na wykładach.

Student zwolniony otrzymuje liczbę punktów proporcjonalną do liczby punktów uzyskanych z kolokwiów/kartówek.

6. Podstawą do wystawienia oceny końcowej z przedmiotu (egzaminu) jest łączna suma punktów uzyskanych przez studenta (maksimum 100 punktów), na którą składa się liczba punktów zdobyta na egzaminie, liczby punktów zdobytych z kolokwiów 25% wszystkich punktów i liczby punktów z kartówek wszystkich punktów. Ocena końcowa zgodna jest z poniższą skalą ocen.

Skala ocen:

- niedostateczny – do 44,99 punktów,
- dostateczny – od 45,00 do 60, 00 punktów,
- dostateczny plus – od 60,01 do 70,00 punktów,
- dobry – od 70,01 do 80,00 punktów
- dobry plus – od 80,01 do 90,00 punktów,
- bardzo dobry – od 90,01 punktów.

Wykaz literatury podstawowej i uzupełniającej	Literatura podstawowa: <ol style="list-style-type: none">1. S.R. Pliska Wprowadzenie do matematyki finansowej. Modele z czasem dyskretny WNT, Warszawa 2005 (BIM 7508).2. J.C Hull Kontrakty terminowe i opcje. Wprowadzenie WIG Press, Warszawa 1997 (BIM 6479).3. A. Weron, R. Weron Inżynieria finansowa WNT, Warszawa 1998 (BIM 6638).
---	---

.....
podpis osoby składającej sylabus