**Nazwa przedmiotu:**

Funkcjonowanie rynków finansowych

**Koordynator przedmiotu:**

Dr inż. Andrzej Kulik

**Status przedmiotu:**

Obowiązkowy

**Poziom kształcenia:**

Studia I stopnia

**Program:**

Matematyka

**Grupa przedmiotów:**

Przedmioty specjalnościowe i specjalizacyjne

**Kod przedmiotu:**

**Semestr nominalny:**

7 / rok ak. 2011/2012

**Liczba punktów ECTS:**

2

**Liczba godzin pracy studenta związanych z osiągnięciem efektów uczenia się:**

**Liczba punktów ECTS na zajęciach wymagających bezpośredniego udziału nauczycieli akademickich:**

**Język prowadzenia zajęć:**

polski

**Liczba punktów ECTS, którą student uzyskuje w ramach zajęć o charakterze praktycznym:**

**Formy zajęć i ich wymiar w semestrze:**

|  |  |
| --- | --- |
| Wykład:  | 30h |
| Ćwiczenia:  | 0h |
| Laboratorium:  | 0h |
| Projekt:  | 0h |
| Lekcje komputerowe:  | 0h |

**Wymagania wstępne:**

Przedmioty poprzedzające:

- Analiza portfelowa
- Instrumenty pochodne
- Inwestycje finansowe

**Limit liczby studentów:**

**Cel przedmiotu:**

.

**Treści kształcenia:**

Program wykładu:
- Funkcjonowanie rynku długu i rynku instrumentów pochodnych OTC
- Wprowadzenie do ryzyka kredytowego
- Zastosowanie modeli strukturalnych i zredukowanych do określania sytuacji kredytowej
- Portfelowe kredytowe instrumenty pochodne (CDO)

Program ćwiczeń:
- wycena instrumentów pochodnych OTC
- konstrukcja krzywej zerokuponowej
- wyznaczanie prawdopodobieństw niewypłacalności

**Metody oceny:**

Zaliczenie testu z pytaniami z zakresu przerabianego materiału (multiple choice).
Ocenę punktową przelicza się na stopnie według poniższych zasad:
• 3.0 jeżeli uzyskali od 51 do 60 pkt.
• 3.5 jeżeli uzyskali od 61 do 70 pkt.
• 4.0 jeżeli uzyskali od 71 do 80 pkt.
• 4.5 jeżeli uzyskali od 81 do 90 pkt.
• 5.0 jeżeli uzyskali powyżej 90 pkt.

**Egzamin:**

**Literatura:**

- Inżynieria Finansowa – Weron, Weron (PWT, 2005)
- Risk Management – Crouchy, Galai, Mark (McGraw-Hill)
- Credit Derivatives – Chaplin (Wiley)
- Swaps and Other Derivatives – Flavell (Wiley)

**Witryna www przedmiotu:**

**Uwagi:**

## Efekty przedmiotowe