

Назва дисципліни	2-112-7 Стохастичні моделі ціноутворення опціонів
Рекомендується для галузі знань (спеціальності, освітньої програми)	11 Математика та статистика
Кафедра	МСТ
П.І.П. НПП (за можливості)	
Рівень ВО	Другий (магістерський)
Курс (на якому буде викладатись)	1 курс
Мова викладання	Українська
Вимоги до початку вивчення дисципліни	Математичний аналіз, Теорія ймовірностей, Інформатика та програмування
Що буде вивчатися	Похідні фінансові інструменти: форвардні та ф'ючерсні контракти, опціони
Чому це цікаво/треба вивчати	В розвинених фінансових системах більшу частину всіх фінансових інвестицій складають інвестиції в похідні фінансові інструменти. Пояснюється це тим, що похідний фінансовий інструмент можна сконструювати так, що він буде задовольняти вимогам кожного окремого інвестора. Похідні фінансові інструменти широко використовуються учасниками фінансового ринку всіх категорій: арбітрами, спекулянтами, хеджерами. Саме тому методи оцінки похідних фінансових інструментів та основні стратегії їх використання цікаво вивчати.
Чому можна навчитися (результати навчання)	Розв'язувати основну задачу фінансової теорії: оцінювати фінансові ризики, яких зазнають активи
Як можна користуватися набутими знаннями і уміннями (компетентності)	Здатність оцінювати ризики для прийняття рішень щодо фінансових інвестицій
Інформаційне забезпечення	Ширяев А.Н. Основы стохастической финансовой математики. В 2-х т. – М.: Фазис, 1998. Барбаумов В.Е., Гладких И.М., Чуйко А.С. Финансовые инвестиции: учебник. – М.: Финансы и статистика, 2003. – 544 с.
Види навчальних занять (лекції, практичні, семінарські, лабораторні тощо)	Лекції, практичні заняття
Вид семестрового контролю	Диференційований залік
Максимальна кількість здобувачів	25
Мінімальна кількість здобувачів (для мовних та творчих дисциплін)	—