

Код та назва дисципліни	2-112-7 Стохастичні моделі ціноутворення опціонів
Рекомендується для галузі знань	Для усіх спеціальностей галузей знань 07, 09, 10, 11, 12, 13, 14, 16, 17 та спеціальностей 014.04, 014.06, 014.08
Кафедра	Статистики й теорії ймовірностей
П.І.П. НПП	Бондаренко Яна Сергіївна
Рівень ВО	Другий (магістерський)
КУРС, семестр (в якому буде викладатись)	Курс: будь-який. Семестр: будь-який.
Мова викладання	Українська
Пререквізити (передумови вивчення дисципліни)	Знання з дисциплін: «Математичний аналіз» або «Вища математика», «Інформатика та програмування» або «Програмування» або «Алгоритмізація 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.
Чого можна навчатися	Розв'язувати основну задачу фінансової теорії: оцінювати фінансові ризики, яких зазнають активи
Як можна користуватися набутими знаннями і уміннями	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 заняття
Вид семестрового контролю	Диференційований залік
Максимальна кількість здобувачів на семестр	—
Мінімальна кількість здобувачів	—

В.о. декана факультету \_\_\_\_\_ Олександр ХАМІНІЧ