**Nazwa przedmiotu:**

Modelowanie stochastyczne rynków finansowych i ubezpieczeniowych - seminarium 2

**Koordynator przedmiotu:**

dr Mariusz Niewęgowski

**Status przedmiotu:**

Obowiązkowy

**Poziom kształcenia:**

Studia II stopnia

**Program:**

Matematyka

**Grupa przedmiotów:**

Wspólne

**Kod przedmiotu:**

1120-MAMUF-NSP-0013

**Semestr nominalny:**

3 / rok ak. 2019/2020

**Liczba punktów ECTS:**

3

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

1. godziny kontaktowe – 32 h; w tym
a) obecność na ćwiczeniach – 35 h
b) konsultacje – 2 h
2. praca własna studenta – 40 h; w tym
a) przygotowanie referatu – 30 h
b) zapoznanie się z literaturą – 10 h
Razem 72 h, co odpowiada 3 pkt. ECTS

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

a) obecność na ćwiczeniach – 30 h
b) konsultacje – 2 h
Razem 32 h, co odpowiada 1 pkt. ECTS

**Język prowadzenia zajęć:**

polski

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

.

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

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

**Wymagania wstępne:**

Podstawy Analizy Stochastycznej, Matematyka Finansowa 1

**Limit liczby studentów:**

Bez limitu

**Cel przedmiotu:**

Zapoznanie z najnowszymi kierunkami badań w matematyce finansowej i ubezpieczeniowej.

**Treści kształcenia:**

Seminarium nie ma ściśle określonych treści gdyż tematy zmieniają się z roku na rok. Tematyka seminarium jest związana z zastosowaniem metod stochastycznych w finansach i ubezpieczeniach m.in. z
1. metodami wyceny instrumentów pochodnych,
2. ryzykiem kredytowym i płynności,
3. zarządzaniem ryzykiem w finansach i ubezpieczeniach,
4. praktycznymi i teoretycznymi aspektami miar ryzyka.

**Metody oceny:**

Ocena wystawiana jest na podstawie jakości wygłoszonego referatu i przygotowanego konspektu. Wygłoszenie referatu osobiście jest warunkiem koniecznym zaliczenia.

**Egzamin:**

nie

**Literatura:**

Nie ma określonej literatury, stanowią ją często najnowsze prace z matematyki finansowej I ubezpieczeniowej którę ukazują się w czasopismach naukowych takich jak „Finance and Stochastic” lub „Mathematical Finance” lub „Finance, Insurance and Economics”

**Witryna www przedmiotu:**

brak

**Uwagi:**

.

## Charakterystyki przedmiotowe

### Profil ogólnoakademicki - wiedza

**Charakterystyka MSR2\_W01:**

Ma wiedzę na temat najnowszych kierunków badań w matematyce finansowej i ubezpieczeniowej.

Weryfikacja:

Referat

**Powiązane charakterystyki kierunkowe:** M2\_W01, M2\_W02, M2\_W03, M2MUF\_W07, M2MUF\_W13

**Powiązane charakterystyki obszarowe:**

**Charakterystyka MSR2\_W02:**

Zna źródła w których są dostępne informacje związane najnowszymi trendami w modelowaniu rynków finansowych i ubezpieczeniowych

Weryfikacja:

Referat

**Powiązane charakterystyki kierunkowe:** M2\_W02, M2\_W03, M2MUF\_W07, M2MUF\_W13

**Powiązane charakterystyki obszarowe:**

### Profil ogólnoakademicki - umiejętności

**Charakterystyka MSR2\_U01:**

Potrafi wyszukać w literaturze fachowej informacje na zadany temat.

Weryfikacja:

Referat

**Powiązane charakterystyki kierunkowe:** M2\_U02, M2MUF\_U15

**Powiązane charakterystyki obszarowe:**

**Charakterystyka MSR2\_U02:**

Potrafi przedstawić postaci referatu informacje o wybranym kierunku badań związanych z najnowszymi trendami w matematycznym modelowaniu w finansach i ubezpieczeniach.

Weryfikacja:

Referat

**Powiązane charakterystyki kierunkowe:** M2\_U01, M2MUF\_U05, M2MUF\_U16, M2\_U03

**Powiązane charakterystyki obszarowe:**

### Profil ogólnoakademicki - kompetencje społeczne

**Charakterystyka MSR2\_K01:**

Potrafi pracować w zespole nad przygotowaniem referatu.

Weryfikacja:

Referat

**Powiązane charakterystyki kierunkowe:** M2MUF\_K01, M2MUF\_K02, M2\_K01

**Powiązane charakterystyki obszarowe:**