

**Tárgy:** Bevezetés a pénzügyi matematikába

**Kurzuskód:** TMBE0451

**Oktató:** Aradi Bernadett

**Félév:** 2018/2019, 2. félév

**Óraszám/hét:** 2+2 (előadás+gyakorlat)

**Kredit:** 3+2

**Tematika:**

1–4. hét: Opció szerződések. Tényezők, korlátok az árakra. Határidős ügyletek.

5–6. hét: Opcióárazás diszkrét idejű piacokon.

7–9. hét: Folytonos idejű modellek, opcióárazás a Black–Scholes modellben.

10. hét: Görögök és számításuk.

11. hét: Numerikus kérdések.

**Követelmények:**

*Gyakorlati jegy:*

- A gyakorlatokon való részvétel kötelező, hiányzás: legfeljebb 3 alkalommal.
- Gyakorlati jegyet az utolsó héten megírt dolgozat alapján kapnak a hallgatók. A dolgozat tárgya: feladatmegoldás.  
Javítási lehetőség: a vizsgaidőszak elején, később egyeztetett időpontban.

*Ponthatárok:*

85 – 100%  $\Rightarrow$  5

75 – 84%  $\Rightarrow$  4

65 – 74%  $\Rightarrow$  3

50 – 64%  $\Rightarrow$  2

0 – 49%  $\Rightarrow$  1

*A vizsgára jelentkezés feltétele:* a gyakorlaton legalább elégséges jegy megszerzése.

**Vizsga típusa:** szóbeli, tételsor alapján.

**Irodalom:**

- Hull, J.C.: Opciók, határidős ügyletek és egyéb származtatott termékek, Panem-Prentice Hall, 1999.

**Fogadóórák:** szerda és csütörtök 14–15, helye: IK-213.

**Etikai elvárások:** A hallgatókkal kapcsolatos etikai normákra a Debreceni Egyetem Etikai Kódexe az irányadó lsd.: <https://unideb.hu/szabalyzatok>.