



VAASAN YLIOPISTO

Johdannaiset

LASK2003 (5 op)

KURSSIKUVAUS

Syksy 2012



VAASAN YLIOPISTO

Johdannaiset

- **Järjestäjä:** Laskentatoimen ja rahoituksen yksikkö
- **Koodi:** LASK2003
- **Opintopisteet:** 5 op
- **Tavoitteet:** Opintojakso on johdatus johdannaisiin. Opiskelija tutustuu opintojakson aikana johdannaisinstrumentteihin, johdannaismarkkinoiden toimintaperiaatteisiin, johdannaisten eri käyttötapoihin ja optioteorian perusteisiin. Opintojakson jälkeen opiskelija tietää, mitä johdannaisinstrumentit ovat, mihin niitä käytetään ja miten johdannaisten hinta määräytyy. Opintojakso kehittää opiskelijan valmiuksia analyyttiseen ajatteluun ja tarjoaa lähtökohdan optioteorian ymmärtämiseen ja soveltamiseen. Opintojakso antaa opiskelijoille myös käytännön valmiuksia johdannaisinstrumenttien hinnoitteluun ja suunnitteluun sekä hyödyntämiseen riskienhallinnassa.
- **Sisältö:** Johdannaisinstrumentit, johdannaismarkkinat, johdannaisten pääkäyttötavat, johdannaiset ja riskienhallinta, termiinien ja futuurien hinnoittelu, optioteorian perusteet, option arvoon vaikuttavat tekijät, optioiden hinnoittelu, optioteorian sovellukset, kaupankäyntistrategioita johdannaisilla
- **Opetus:** Luennot 20 h., viikot 37-41
- **Luennoitsija:** Prof. Sami Vähämaa
 - Vastaanottoaika: ke 14.15-15.00
 - Puh. (06) 324 8197



VAASAN YLIOPISTO

■ Kirjallisuus:

- Hull, John C. (2011). *Options, Futures, and Other Derivatives*. 8th Edition, Prentice Hall.
- Hull, John C. (2008). *Options, Futures, and Other Derivatives*. 7th Edition, Prentice Hall.

■ Luentomateriaali:

- Luentomateriaali saatavissa osoitteesta
<http://www.uwasa.fi/~sami/johdannaiset.html>

■ Aiemmat opinnot: Rahoituksen perusteet (LASK1008), Tilinpäätösanalyysi (LASK1006)

■ Vaatimukset: Tentti

■ Tentit: (1) Ke 24.10.2012, (2) Ma 10.12.2012?, (3) Helmikuu 2013? Kurssista ei järjestetä ylimääräisiä tenttejä.

■ Opintosuorituksen arviointi (alustava):

Arvosana	Pisteet
Erinomainen (5/5)	22–24
Erittäin hyvä (4/5)	18.5–21.5
Hyvä (3/5)	16–18
Tyydyttävä (2/5)	13.5–15.5
Välttävä (1/5)	11–13
Hylätty	0–10.5