

ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΚΑΙ ΝΕΑ ΧΡΗΜΑΤΟΟΙΚΟΝΟΜΙΚΑ ΠΡΟΪΟΝΤΑ

1) Εξεταστέα ύλη

Η εξέταση του μαθήματος θα βασιστεί πρωτίστως στις σημειώσεις των διδασκόντων που διανεμήθηκαν κατά τη διάρκεια του εξαμήνου και δευτερευόντως στα προτεινόμενα βιβλία διδασκαλίας. Συγκεκριμένα, η εξεταστέα ύλη για τις περιόδους Ιουνίου και Σεπτεμβρίου απαρτίζεται από τις εξής ενότητες:

A) *Συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης (futures)*

(Σημειώσεις διδασκαλίας διδασκόντων)

B) *Δικαιώματα προαίρεσης*

Ορισμοί, Διαγράμματα κέρδους – ζημίας, Εσωτερική αξία – Χρονική αξία options, Σύνθετες Στρατηγικές Αποτίμησης

(Σημειώσεις διδασκαλίας διδασκόντων & Κεφ. 12 του βιβλίου του Παπαϊωάννου (ενδεικτικά))

Γ) *Διώνυμο υπόδειγμα αποτίμησης δικαιωμάτων (call-put) αμερικάνικου ή ευρωπαϊκού τύπου*

(Σημειώσεις διδασκαλίας διδασκόντων και Σημειώσεις από το ΧΠΑ που διανεμήθηκαν στην τάξη)

Δ) *Το υπόδειγμα αποτίμησης δικαιωμάτων των Black & Scholes και η ισοδυναμία δικαιωμάτων αγοράς και πώλησης (call – put parity)*

(Σημειώσεις διδασκαλίας διδασκόντων και άρθρο Ν. Μυλωνά)

Ε) *Σύνθετες στρατηγικές με παράγωγα*

(Σημειώσεις διδασκαλίας διδασκόντων και απόσπασμα από το βιβλίο του Παπαϊωάννου που διανεμήθηκε στην τάξη)

ΣΤ) *Αγορές συναλλάγματος*

(Κεφ. 2 Παπαϊωάννου, πλην παραγράφου 7)

Ζ) *Προθεσμιακή αγορά συναλλάγματος*

(Κεφ. 8 Παπαϊωάννου, Παράγραφοι: 1, 2 (πλην παραδείγματος), 3, 4, 5, 6.1 και 8 (μέχρι κανόνα 1))

Η) *Μελλοντικές συμφωνίες επιτοκίου (future rate agreements)*

(Κεφ 9 Παπαϊωάννου)

Θ) *Επιτοκιακά δικαιώματα (interest rate options)*

(Κεφ, 13 Παπαϊωάννου)

2) Επιπρόσθετο υλικό

Φυλλάδια ασκήσεων 1-4.

3) Βαθμολογία:

Τελικό διαγώνισμα: συντελεστής στάθμισης 100%

Στο διαγώνισμα θα επιτρέπεται η χρήση όλων των βιβλίων και σημειώσεων.