

POLITECHNIKA KRAKOWSKA IM. TADEUSZA KOŚCIUSZKI

KARTA PRZEDMIOTU

obowiązuje studentów rozpoczynających studia w roku akademickim 2012/2013

Wydział Fizyki, Matematyki i Informatyki

Kierunek studiów: Matematyka

Profil: Ogólnoakademicki

Forma studiów: stacjonarne

Kod kierunku: M

Stopień studiów: II

Specjalności: Matematyka w finansach i ekonomii

1 INFORMACJE O PRZEDMIOCIE

NAZWA PRZEDMIOTU	Ekonofizyka
NAZWA PRZEDMIOTU W JĘZYKU ANGIELSKIM	
KOD PRZEDMIOTU	WFMiI M oIIS C3 12/13
KATEGORIA PRZEDMIOTU	Przedmioty kierunkowe
LICZBA PUNKTÓW ECTS	5.00
SEMESTRY	2

2 RODZAJ ZAJĘĆ, LICZBA GODZIN W PLANIE STUDIÓW

SEMESTR	WYKŁAD	ĆWICZENIA	LABORATORIUM	LABORATORIUM KOMPUTERO- WE	SEMINARIUM	PROJEKT
2	30	30	0	0	0	0

3 CELE PRZEDMIOTU

Cel 1 Przedstawienie podstaw fizycznego opisu rzeczywistości

Cel 2 Ukazanie metod fizyki teoretycznej, przydatnych w matematyce, finansach i ekonomii

4 WYMAGANIA WSTĘPNE W ZAKRESIE WIEDZY, UMIEJĘTNOŚCI I INNYCH KOMPETENCJI

1 Podstawy analizy matematycznej, algebry i rachunku prawdopodobieństwa

5 EFEKTY KSZTAŁCENIA

EK1 Wiedza Znajomość podstaw fizycznego opisu zjawisk przyrodniczych

EK2 Umiejętności Umiejętność adekwatnego wyboru modelu fizycznego do opisu wybranych zjawisk

EK3 Wiedza Wiedza w zakresie podstawowych pojęć i metod ekonofizyki

EK4 Umiejętności Praktyczna umiejętność wykorzystania metod ekonofizyki do opisu zjawisk na rynku finansowym oraz wyceny giełdowych instrumentów finansowych

6 TREŚCI PROGRAMOWE

WYKŁAD		
LP	TEMATYKA ZAJĘĆ OPIS SZCZEGÓŁOWY BLOKÓW TEMATYCZNYCH	LICZBA GODZIN
W1	Wstęp: motywacja - fizyka a finanse. Fizyka a matematyka. Czym zajmuje się ekonofizyka? Cechy fizycznych układów złożonych a charakterystyka rynków finansowych. Przegląd klasycznych pojęć fizyki w ujęciu matematycznym.	6
W2	Procesy stochastyczne w fizyce: układy klasyczne i złożoność ich zachowania. Termodynamika fenomenologiczna i fizyka statystyczna - podstawy opisu zachowania wielociałowych układów złożonych. Klasyczne i kwantowe statystyki oraz funkcje rozkładu. Zespoły statystyczne a upływ czasu. Błądzenie przypadkowe w fizyce i finansach: ruchy Browna i dyfuzja. Klasyczne przeskoki losowe i kwantowe prawdopodobieństwa przejść. Fluktuacje klasyczne i kwantowe: fizyczne przykłady. Pomiar wielkości przypadkowych i fluktuacji fizycznych.	8
W3	Zjawiska fizyczne a opis idealnego rynku finansowego: Od dyfuzji do modelu Blacka-Scholesa. Równanie Blacka-Scholesa a równanie Schrödingera. Gaussowski charakter procesów fizycznych a hipoteza rynku gaussowskiego.	4
W4	Zagadnienia rynku rzeczywistego: przykłady niegaussowskiego charakteru zjawisk w fizyce i na rynkach finansowych. Założenia modelu Blacka-Scholesa a realia rynku finansowego.	6
W5	Fizyczne i techniczne metody analizy rynków finansowych: korelacje w fizyce i na rynku finansowym. Przykłady korelacji klasycznych i kwantowych. Analiza spektralna w fizyce. Sygnał i szum. Analiza techniczna danych finansowych. Teoria macierzy przypadkowych w opisie układów fizycznych i rynków finansowych. Przepływy turbulentne a dynamika cen. Zjawiska krytyczne a krachy na giełdzie.	6

ĆWICZENIA		
LP	TEMATYKA ZAJĘĆ OPIS SZCZEGÓŁOWY BLOKÓW TEMATYCZNYCH	LICZBA GODZIN
C1	Zagadnienia fizyczne z klasycznej dynamiki. Model gazu doskonałego. Funkcje stanu. Rozkład Boltzmanna. Suma statystyczna i wyznaczanie wielkości termodynamicznych. Rozkład Maxwella prędkości cząstek w gazie. Entropia fenomenologiczna i statystyczna. Zanik wykładniczy i zanik potęgowy. Statystyka Bosego i Fermiego. Przykłady rozwiązań równania Schrödingera. Operatory i równania własne. Wartości średnie operatorów. Probabilistyczna interpretacja funkcji falowej. Fluktuacje i zaburzenia - rozmaite przykłady. Wycena instrumentów pierwotnych i pochodnych.	30

7 NARZĘDZIA DYDAKTYCZNE

N1 Wykłady

N2 Prezentacje multimedialne

N3 Dyskusja

N4 Zadania tablicowe

8 OBCIĄŻENIE PRACĄ STUDENTA

FORMA AKTYWNOŚCI	ŚREDNIA LICZBA GODZIN NA ZREALIZOWANIE AKTYWNOŚCI
Godziny kontaktowe z nauczycielem akademickim, w tym:	
Godziny wynikające z planu studiów	0
Konsultacje przedmiotowe	15
Egzaminy i zaliczenia w sesji	15
Godziny bez udziału nauczyciela akademickiego wynikające z nakładu pracy studenta, w tym:	
Przygotowanie się do zajęć, w tym studiowanie zalecanej literatury	30
Opracowanie wyników	0
Przygotowanie raportu, projektu, prezentacji, dyskusji	30
SUMARYCZNA LICZBA GODZIN DLA PRZEDMIOTU WYNIKAJĄCA Z CAŁEGO NAKŁADU PRACY STUDENTA	90
SUMARYCZNA LICZBA PUNKTÓW ECTS DLA PRZEDMIOTU	5.00

9 SPOSOBY OCENY

OCENA FORMUJĄCA

F1 Test

OCENA PODSUMOWUJĄCA

P1 Średnia ważona ocen formujących

KRYTERIA OCENY

EFEKT KSZTAŁCENIA 1	
NA OCENĘ 2.0	Brak wystarczającej znajomości podstaw fizycznego opisu zjawisk przyrodniczych
NA OCENĘ 3.0	Opanowanie podstaw fizycznego opisu zjawisk w stopniu dostatecznym
NA OCENĘ 3.5	Opanowanie podstaw fizycznego opisu zjawisk w stopniu dość dobrym
NA OCENĘ 4.0	Opanowanie podstaw fizycznego opisu zjawisk w stopniu dobrym
NA OCENĘ 4.5	Opanowanie podstaw fizycznego opisu zjawisk w stopniu ponad dobrym
NA OCENĘ 5.0	Opanowanie podstaw fizycznego opisu zjawisk w stopniu bardzo dobrym
EFEKT KSZTAŁCENIA 2	
NA OCENĘ 2.0	Brak wystarczającej umiejętności opisu wybranych zjawisk, brak umiejętności praktycznej wykorzystania wiadomości w opisie podstawowych zjawisk fizycznych i ekonofizycznych
NA OCENĘ 3.0	Umiejętność opisu wybranych zjawisk fizycznych w stopniu dostatecznym
NA OCENĘ 3.5	Umiejętność opisu wybranych zjawisk fizycznych w stopniu dość dobrym
NA OCENĘ 4.0	Umiejętność opisu wybranych zjawisk fizycznych w stopniu dobrym
NA OCENĘ 4.5	Umiejętność opisu wybranych zjawisk fizycznych w stopniu ponad dobrym
NA OCENĘ 5.0	Umiejętność opisu wybranych zjawisk fizycznych w stopniu bardzo dobrym
EFEKT KSZTAŁCENIA 3	
NA OCENĘ 2.0	Brak wystarczającej wiedzy w zakresie podstawowych pojęć i metod ekonofizyki.
NA OCENĘ 3.0	Opanowanie podstawowych pojęć i metod ekonofizyki w stopniu dostatecznym.
NA OCENĘ 3.5	Opanowanie podstawowych pojęć i metod ekonofizyki w stopniu dość dobrym.
NA OCENĘ 4.0	Opanowanie podstawowych pojęć i metod ekonofizyki w stopniu dobrym.
NA OCENĘ 4.5	Opanowanie podstawowych pojęć i metod ekonofizyki w stopniu ponad dobrym.
NA OCENĘ 5.0	Opanowanie podstawowych pojęć i metod ekonofizyki w stopniu bardzo dobrym.

EFEKT KSZTAŁCENIA 4	
NA OCENĘ 2.0	Brak wystarczającej umiejętności wykorzystania pojęć i metod ekonofizyki do opisu zjawisk na rynku finansowym i wyceny giełdowych instrumentów finansowych.
NA OCENĘ 3.0	Umiejętność wykorzystania pojęć i metod ekonofizyki w stopniu dostatecznym.
NA OCENĘ 3.5	Umiejętność wykorzystania pojęć i metod ekonofizyki w stopniu dość dobrym.
NA OCENĘ 4.0	Umiejętność wykorzystania pojęć i metod ekonofizyki w stopniu dobrym.
NA OCENĘ 4.5	Umiejętność wykorzystania pojęć i metod ekonofizyki w stopniu ponad dobrym.
NA OCENĘ 5.0	Umiejętność wykorzystania pojęć i metod ekonofizyki w stopniu bardzo dobrym.

10 MACIERZ REALIZACJI PRZEDMIOTU

EFEKT KSZTAŁCENIA	ODNIESIENIE DANEGO EFEKTU DO SZCZEGÓŁOWYCH EFEKTÓW ZDEFINIOWANYCH DLA PROGRAMU	CELE PRZEDMIOTU	TREŚCI PROGRAMOWE	NARZĘDZIA DYDAKTYCZNE	SPOSOBY OCENY
EK1	K_W09, K_U17, K_U18	Cel 1	W1 W2 C1	N1 N2 N3 N4	F1 P1
EK2	K_W09	Cel 1	W1 W2 C1	N1 N2 N3 N4	F1 P1
EK3	K_W09, K_U17, K_U18	Cel 2	W3 W4 W5 C1	N1 N2 N3 N4	F1 P1
EK4	K_W09, K_U17	Cel 2	W3 W4 W5 C1	N1 N2 N3 N4	F1 P1

11 WYKAZ LITERATURY

LITERATURA PODSTAWOWA

- [1] **R.N. Mantegna, H.E. Stanley** — *Ekonofizyka. Wprowadzenie*, Warszawa, 2001, PWN
- [2] **J. Voit** — *The Statistical Mechanics of Financial Markets*, Berlin, 2001, Springer
- [3] **W. I. Arnold** — *Metody matematyczne mechaniki klasycznej*, Warszawa, 1981, PWN
- [4] **K. Maurin** — *Matematyka a fizyka*, Warszawa, 2010, PWN

LITERATURA UZUPEŁNIAJĄCA

- [1] **F.W. Byron, R. W. Fuller** — *Matematyka w fizyce klasycznej i kwantowej, t.1*, Warszawa, 1975, PWN
- [2] **A. Weron, R. Weron** — *Inżynieria finansowa*, Warszawa, 1999, WNT
- [3] **K. Jajuga, T. Jajuga** — *Inwestycje*, Warszawa, 2007, PWN
- [4] **M. Wiciak** — *Wybrane zagadnienia teorii opcji*, Kraków, 2007, Wydawnictwo PK
- [5] **P. Wilmott, S. Howison, J. Dewynne** — *The Mathematics of Financial Derivatives*, Cambridge, 1999, Cambridge University Press

12 INFORMACJE O NAUCZYCIELACH AKADEMICKICH**OSOBA ODPOWIEDZIALNA ZA KARTĘ**

dr Robert Gębarowski (kontakt: rgebarowski@pk.edu.pl)

OSOBY PROWADZĄCE PRZEDMIOT

1 dr Robert Gębarowski (kontakt: rgebarowski@pk.edu.pl)

13 ZATWIERDZENIE KARTY PRZEDMIOTU DO REALIZACJI

(miejsowość, data)

(odpowiedzialny za przedmiot)

(dziekan)

PRZYJMUJĘ DO REALIZACJI (data i podpisy osób prowadzących przedmiot)

.....