

授業科目名 (英文名)	経営学特講 (金融工学)	科目区分 対象学生	
単位数	2.0	開講年次・ 学期	
担当教員	落合 夏美	所属	
オフィス・場所		連絡先	
講義目的及び到達目標	<p>本講義は、金融工学における、デリバティブの価格付け理論とポートフォリオ選択理論の入門的な内容を理解し、PCを使った演習により、理解を深めることを目的とする。</p> <p>金融工学の基礎理論を身に着け、基本的な計算ができるようになることを目指す。</p>		
講義内容・授業計画	<p>講義内容 金融工学の基礎的な内容を初等的な数学を使って解説する。また、EXCELやRを使った演習を行う。</p> <p>授業計画</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 . 金利と現在価値 2 . 確率の基礎 3 . ポートフォリオ選択理論 4 . CAPM 5 . 演習：ポートフォリオ選択 6 . 金融商品とデリバティブ 7 . スワップ取引 8 . 無裁定価格理論 9 . 無裁定価格理論 10 . 2項モデルによるデリバティブの価格付け 11 . 2項モデルによるデリバティブの価格付け 12 . 離散時間から連続時間へ 13 . ブラックショールズ公式とグリークス 14 . 演習：デリバティブ 15 . 補論 		
テキスト	なし		
参考文献	<p>小林孝雄・芹田敏夫著 (2009) 『新・証券投資論』日本経済新聞出版社</p> <p>ジョン・ハル・著 (三菱UFJモルガンスタンレー証券市場商品本部・訳) (2016) 『 フィナンシャルエンジニアリング 第9版』金融財政事情研究会</p>		
成績評価の基準・方法	複数回のレポート (40%) と期末試験 (60%) を予定		
履修上の注意・履修要件	確率論と統計学に関する基本的な知識がある方が望ましい		
実践的教育	該当しない		
備考			