

電気通信大学 平成21年度シラバス

授業科目名	金融工学特論		
英文授業科目名	Topics in Financial Engineering		
開講年度	2009年度	開講年次	
開講学期	前学期	開講コース・課程	博士後期課程
授業の方法	講義	単位数	2
科目区分	電気通信学研究科-システム工学専攻-専門科目		
開講学科・専攻	システム工学専攻		
担当教官名	宮崎 浩一		
居室	西5-503		

公開E-Mail	授業関連Webページ
miyazaki@se.uec.ac.jp	

【主題および達成目標】
金融工学におけるオプション評価理論のフロンティアについて学ぶ。

【前もって履修しておくべき科目】
金融情報特論 金融情報システム

【前もって履修しておくことが望ましい科目】
確率統計第一、第二、 オペレーションズリサーチA、B

【教科書等】
宮崎浩一著、オプション市場分析、朝倉書店（近刊）

【授業内容とその進め方】
<p>輪講形式でテキストの内容を一つ一つ確認しながら、進めていく。 受講者はレジュメを作成のうえ発表し、疑問点について質疑応答を行い理解を深め手法の習得を行う。 修士課程の科目である金融情報システムで取り扱えなかった以下の章を採り上げる。 4章：ジャンプ拡散モデル 5章：確率ポラティリティモデル など</p>

電気通信大学 平成21年度シラバス

【成績評価方法及び評価基準(最低達成基準を含む)】

発表と質疑応答の内容によって評価する。

【オフィスアワー：授業相談】

金曜日：16:00から17:30

【学生へのメッセージ】

オプション市場分析関連の論文を書くために必要な基本事項を習得しよう。

【その他】

なし
