

電気通信大学 平成17年度シラバス

授業科目名	金融情報システム		
英文授業科目名	Financial Information System		
開講年度	2005年度	開講年次	3年次
開講学期	6学期	開講コース・課程	昼間コース
授業の方法		単位数	2
科目区分	専門科目-学科専門科目-選択科目		
開講学科・専攻	システム工学科		
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	

<p>【主題および達成目標】</p> <p>(a)主題</p> <p>(1)コーポレートファイナンス理論、債券・株式投資理論、オプション理論の全体像を知ると共に、その基礎となる考え方を理解する。</p> <p>(2)金融市場がどのような理由でどのように動いていくのかを市場予測を行なうことで体得する。</p> <p>(3)日本経済新聞の内容が理解できる程度の金融経済用語を習得する。</p> <p>(b)達成目標：</p> <p>(1)企業活動と財務政策を理解する。</p> <p>(2)NPVに基づきプロジェクトの選択ができる。</p> <p>(3)最適ポートフォリオを導出して有効的フロンティアを描くことができる。</p> <p>(4)資本資産評価モデル(CAPM)を理解して利用できる。</p> <p>(5)WACCに基づいて資本コストの算出ができる。</p> <p>(6)負債の評価(債券のリスク分析)ができ、金利期間構造の概念を説明できる。</p> <p>(7)基本的な財務諸表を利用できる。</p> <p>(8)オプションの満期価値を描くことができる。</p> <p>(9)二項モデルを用いたリスク中立評価法を説明できる。</p> <p>(10)ブラック・ショールズ公式の意味を理解して利用できる。</p>
--

電気通信大学 平成17年度シラバス

【前もって履修しておくべき科目】

なし

【前もって履修しておくことが望ましい科目】

オペレーションズ・リサーチA , オペレーションズ・リサーチB

【教科書等】

宮崎浩一 著、
証券分析への招待 サイエントリスト社

【授業内容とその進め方】

第一回	債券数学への招待1
第二回	債券数学への招待2
第三回	債券投資におけるリスクリターン分析1
第四回	債券投資におけるリスクリターン分析2
第五回	株式のリスク・リターンとポートフォリオ投資1
第六回	株式のリスク・リターンとポートフォリオ投資2
第七回	投資家のリスク選好
第八回	配当割引モデル
第九回	資本資産評価モデル
第十回	オプション理論1
第十一回	オプション理論2
第十二回	オプション理論3

電気通信大学 平成17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)】

(a)評価方法：

出席点： 一回2点
市場予測： 的確な予想2点
金融経済書の評論：満点30点
期末試験： 満点50点
上記の合計点で決める。

(b)評価基準：

達成目標に記した事項をある程度理解したといえる水準、
上記試験の合計点が60点以上であること。

【オフィスアワー：授業相談】

金曜日：16:00-18:00

【学生へのメッセージ】

実際に世の中で経営経済がどのように動いているかを
日経新聞から学ぶと共に、それらを説明する基礎的な事項
や概念を学ぼう。

【その他】