

電気通信大学 平成17年度シラバス

授業科目名	金融情報特論		
英文授業科目名	Topics in Financial Strategies		
開講年度	2005年度	開講年次	
開講学期	前学期	開講コース・課程	博士前期課程
授業の方法		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

【主題および達成目標】
<p>学部の授業「金融情報システム」においては、コーポレート・ファイナンスと金融市場に関して概論的な授業を行なった。しかし、そこでは、講義時間の都合もあり、デリバティブの評価に関しては殆ど触れることができなかった。よって、ここでは、金融派生商品とは何か、その評価法や資産運用や財務管理における利用法を学習する。達成目標は、(1)先物、スワップ、オプションとは何かを説明でき、資産運用や財務管理への利用ができること、(2)リスク中立評価法に基づくブラック・ショールズ公式を習得することである。</p>

【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】
金融情報システム、オペレーションズ・リサーチA、B、確率統計工学基礎第1、第2、応用確率解析

【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

電気通信大学 平成17年度シラバス

【授業内容とその進め方】

デリバティブの評価を行なうにあたっては、確率過程論の基礎的な知識を前提としたうえで、数式が表現するファイナンス的意味合いを一步一步追っていくような地道な鍛錬が必要になる。よって、通論形式の一方方向の講義よりは、たとえ牛のような歩みであったとしても輪講形式で学生諸氏に発表していただいたうえで質疑応答を繰り返してテキストを熟読玩味していく方が、学習効果があがると考えている。学生は、予め与えられたテキストの部分を1時間でプレゼンテーションを行い、30分間は、本科目を履修する全員からの疑問点に答えなければならない。本年度に、輪講を予定している箇所は、以下の章である。

第8章 オプションとは？その性質と投資戦略

第9章 オプション評価に関する2つの方法論

第10章 オプションのリスク指標と様々な派生証券取引

第12章 企業財務におけるオプション理論

【成績評価方法及び評価基準(最低達成基準を含む)】

プレゼンテーションと質疑応答の水準により評価する。

【オフィスアワー：授業相談】

木曜日5限

【学生へのメッセージ】

金融派生商品とは何か、その評価法や資産運用や財務管理における利用法を学びましょう。

【その他】