

《金融工程》教学日历

章	课时	具体授课内容	课时	教学周
第一章 金融工程概述	3	1.1 什么是金融工程	0.5	4
		1.2 远期	0.5	4
		1.3 期货	0.5	4
		1.4 互换	0.5	4
		1.5 期权	0.5	4
		1.6 金融产品定价的基本原理	0.5	4
第二章 远期与期货概述	3	2.1 远期与远期市场	1	5
		2.2 期货与期货市场	1	5
		2.3 远期与期货的比较	1	5
第三章 远期与期货定价	3	3.1 远期价格与期货价格	1	7
		3.2 无收益资产远期合约的定价	0.5	7
		3.3 支付已知现金收益资产远期合约的定价	0.5	7
		3.4 支付已知收益率资产远期合约的定价	0.5	7
		3.5 远期（期货）价格与标的资产现货价格的关系	0.5	7
第四章 远期与期货的运用	2	4.1 运用远期与期货进行套期保值	1	8
		4.2 运用远期与期货进行套利与投机	1	8
第五章 股指期货、外汇远期、利率远期与利率期货	3	5.1 股价指数期货	0.5	9
		5.2 外汇远期	0.5	9
		5.3 远期利率协议	1	9
		5.4 利率期货	1	9
第六章 互换的定价与风险分析	3	6.1 互换的定义与种类	0.5	10
		6.2 互换市场	0.5	10
		6.3 利率互换的定价	1	10
		6.4 货币互换的定价	0.5	10
		6.5 互换的风险	0.5	10
第七章 互换的运用	3	7.1 运用互换进行套利	1	11
		7.2 运用互换进行风险管理	1	11
		7.3 运用互换构造新产品	1	11
第八章 期权与期权市场	3	8.1 期权的定义与种类	1	12
		8.2 期权市场	0.5	12
		8.3 期权交易机制	1	12
		8.4 期权与其他衍生产品的区别与联系	0.5	12

章	课时	具体授课内容	课时	教学周
第九章 期权的回报与价格分析	3	9.1 期权的回报与盈亏分布	1.5	13
		9.2 期权价格的特征	1.5	13
第十章 布莱克—舒尔斯—默顿期权定价模型	3	10.1 模型基本思路	1.5	14
		10.2 布莱克—舒尔斯—默顿期权定价公式	1.5	14
第十一章 期权定价的数值方法	3	11.1 二叉树期权定价模型	1.5	15
		11.2 蒙特卡洛模拟	1.5	15
期末考试	2	期末考试	2	15