

교과목명	금융공학2		학수번호	11792001	이수	전선	학점	3
강의시간	월C,월D	강의실	가천관-619					
선수과목	금융개론		공학인증 이수구분					
교수소속	경영대학 금융수학과	교수성명	박도현	연락처				
e-mail								
홈페이지/카페				조교				

강의 개요

금융공학1 에서 배운 기초적인 파생상품의 지식을 바탕으로 옵션을 이용한 투자전략 및 파생상품의 그릭과 변동성에 대해서 배운다.

강의 목표

시장에서 거래되는 파생상품을 이해할 수 있는 능력을 배양한다.

강의 진행방법

강의실 강의 및 학기중 현장 견학

평가요소	성적 평가방법	비율
출석	학기 중 랜덤으로 출석체크	15
중간고사	시험	30
기말고사	시험	40
레포트	과제	15
그룹 프로젝트		0
기타		0
합 계		100

교과목명	금융공학2		학수번호	11792001	이수	전선	학점	3
강의시간	월C,월D	강의실	가천관-619					

과제명 및 과제작성 방법안내	제출일	제출물 유형 및 제출방법
교재연습문제1		
교재연습문제2		
교재연습문제3		

* 과제지연시 패널티 기준 : 과제 지연시 무조건 0점 처리

구분	교재명	저자	출판사	출판년도
주교재	선물, 옵션 투자의 이론과 전략	John Hull	퍼스트북	
부교재				
참고자료				

강의 규정 (학습자 유의사항)
1. 수업중 휴대폰 절대 금지 (조작시 퇴장 조치) 2. 과제제출은 수업시작 전에 완료 (수업 시작후 과제 안받음) 3. 학점을 위한 추가 시험 및 숙제 절대 없음.

장애학생 지원내용

교과목명	금융공학2		학수번호	11792001	이수	전선	학점	3
강의시간	월C,월D		강의실	가천관-619				
주차	기간	수업내용 및 학습활동						
1	08/31 ~ 09/06	선물 옵션 리뷰						
2	09/07 ~ 09/13	옵션을 이용한 투자전략						
3	09/14 ~ 09/20	스프레드						
4	09/21 ~ 09/27	이항모형						
5	09/28 ~ 10/04	추석연휴						
6	10/05 ~ 10/11	이항모형과 헤지거래						
7	10/12 ~ 10/18	선물옵션의 속성, 평가하기						
8	10/19 ~ 10/25	중간고사						
9	10/26 ~ 11/01	그릭문자: 델타, 감마						
10	11/02 ~ 11/08	그릭문자: 세타, 베가						
11	11/09 ~ 11/15	변동성 미소						
12	11/16 ~ 11/22	변동성의 기간구조						
13	11/23 ~ 11/29	변동성 표면과 그릭문자						
14	11/30 ~ 12/06	이항모형을 통한 옵션의 가치평가						
15	12/07 ~ 12/13	몬테카를로 시뮬레이션						
16	12/14 ~ 12/20	기말고사						