

수업계획서

2018학년도 2학기			
과목명	선물옵션	학수번호	MGT3003-01
학점/시간	3/3	이수학년	3-4
선수과목	재무관리, 투자론	평가유형	상대평가
면담시간(Office Hour)	강의시간 후, 약속	강좌홈페이지	

1. 교과목개요

본 과목은 파생상품의 종류와 가격결정 및 파생금융상품시장의 구조에 관한 내용을 다룬다. 본 과목은 재무금융 과목 가운데 하나로 재무관리(또는 투자론)에 대한 지식이 필수적으로 필요하다. 과목 특성상 수리적 모형이 빈번히 이용된다.

2. 수업목표

선물 옵션 및 스왑과 같은 파생금융상품에 대한 이해를 제고하고 응용과 관련된 지식을 습득한다.

4. 선수학습내용

재무관리, 투자론 기본내용(현재가치, 미래가치, 포트폴리오 이론, 채권이론 등)에 대한 지식이 필요

5. 평가방법

시험			수행과제			기타		기타
중간고사	기말고사	퀴즈	프로젝트	과제물	발표	출석	수업참여도	
35%	35%	0%	%	15%	%	10%	5%	%
비고								

6. 수행과제

과제유형	과제명	제출기한
과제물	연습문제 풀이	

7. 교재

구분	도서명	저자	출판사	출판년도	ISBN
주교재	파생상품의 평가와 헷징 전략, 8판	Hull (김철중, 윤평식)	Pearson	2014	979118547501933

주차별 수업계획

1주차	Introduction & 파생상품의 등장 배경과 개요
2주차	선물시장의 구조
3주차	3장 선물을 이용한 헷징 전략
4주차	4장 이자율
5주차	추석
6주차	5장 선도가격결정모형
7주차	5장 선도가격결정모형
8주차	중간고사
9주차	9장 옵션시장의 구조
10주차	10장 주식옵션의 기본성격
11주차	11장 옵션을 이용한 투자전략
12주차	12장 이항모형
13주차	13장 블랙-숄즈-머튼 모형
14주차	17장 그릭 문자, 19장 변동성 미소
15주차	7장 스왑
16주차	기말고사