

经济学院 金融工程 课程教学大纲

一、 基本介绍:

授课教师: 郑振龙

答疑时间: 周二下午 16:00-18:00

答疑地点: 经济学院 E-303

答疑邮箱: zlzhen@xmu.edu.cn

教学助理: 黄海峰

联系方式: 295493382@qq.com

答疑时间: 周三晚上 19:00-21:00

答疑地点: 经济学院 E-303

二、 课程安排说明:

有效教学时间: 周一下午 5-6 节, 周三上午 1-2 节

开课年级: 2009 级

课程类型: 方向性课程

学分: 3

总学时: 56

三、 教材

使用教材: 郑振龙、陈蓉主编, 《金融工程》(第二版), 2008, 高等教育出版社

参考书目: Hull, J.C., Options, Futures, and Other Derivatives, 8th Edition. 2012, Pearson Education.

四、 分数说明

作业 20%, 半期考 40%, 期末考 40%

五、 课程进度

周序	教学内容	课时安排	备注
1	金融工程概述	2	
2	远期与期货概述、定价	4	
3	远期与期货定价、运用	4	
4	国庆放假		
5	远期与期货运用、股指期货	4	
6	外汇期货、利率远期与利率期货	4	
7	互换概述与定价	4	

8	互换运用、案例讨论	4	
9	半期考试周		
10	期权与期权市场	4	
11	期权的回报与价格分析	4	
12	BSM 期权定价模型	4	
13	期权定价的数值方法	4	
14	期权的交易策略及其运用	4	
15	期权价格的敏感性和期权的套期保值	4	
16	期末复习		
17	期末考试周		
18	期末考试周		

六、其他说明：

请按时上交作业，过期不收。