

ファイナンス FH32 041 / K72 1401

第1学期 木曜3・4時限 (2単位)

対象：2-3年生

担当教員：辻爾志 3F1216 電話 853-6451

E-mail: tsuji@sk.tsukuba.ac.jp Office hours：授業でアナウンスする

教科書：D. G. ルーエンバーガー著（今野浩他訳）『金融工学入門』日本経済新聞社(2002)
その他参考文献等は適宜授業中に紹介する

授業概要・教育目標

アセット・プライシング・モデル、ポートフォリオ理論、デリバティブズのプライシング、行動ファイナンスなどのファイナンスにおける基礎理論・基礎概念を習得する。なお、ファイナンスに関する最近の新しい研究やトピックスについても概観し、ファイナンス分野に関するより広い理解も促進する予定である。

授業計画

| | |
|------|------------------|
| 第1週 | イントロダクション |
| 第2週 | ファイナンスの基礎理論と基礎概念 |
| 第3週 | ポートフォリオ理論 |
| 第4週 | アセット・プライシング・モデル |
| 第5週 | オプション |
| 第6週 | 課題1 |
| 第7週 | 市場効率性 |
| 第8週 | 行動ファイナンス |
| 第9週 | 最近の研究事例等の紹介 |
| 第10週 | 課題2 |

成績評価：主として中間および期末のプレゼンテーションにより評価する

備考：授業計画は状況により多少の変更を行う場合がある