

## 金融リスク管理論 FH22 051 / K62 1501

第1学期 金曜3, 4時限(2単位)	対象: 主に2~4年生
担当教員: 高橋 正文 3F1203 電話 853-5559 E-mail <a href="mailto:masa@sk.tsukuba.ac.jp">masa@sk.tsukuba.ac.jp</a> Office hour: 月曜、水曜の11~12時	
教科書: 参考書として、Philippe Jorion(1997), Value at Risk, Irwin Publishing を推奨する。	
授業概要・教育目標: 主に確率過程と統計の基礎論を使って金融資本市場に内在するリスクを計量する。	

授業計画:	
第1週	V a R とは何か、リスクのタイプ、倒産のケース・スタディ
第2週	リスク管理で使われる確率と統計の基礎
第3週	リスク管理で使われる確率過程の基礎
第4週	金融市場、金融商品、V a R、及びその数学的表現
第5週	デリバティブと非線形V a R
第6週	金利感応証券と非線形V a R
第7週	ポートフォリオのV a R
第8週	インクリメンタルV a R、ベータリスク、平滑化法、GARCH
第9週	信用リスクのV a R
第10週	伝統的V a Rと新しい計測手法に関する話題

成績評価: 授業への出席回数(30%)と課題提出(70%)
備考: 微積分、確率統計の授業を受け、単位を取得していることが望ましい