

课程教学进度计划表

一、基本信息

课程名称	金融工程学				
课程代码	2060363	课程序号	2	课程学分/学时	3/48
授课教师	陈明	教师工号	19155	专/兼职	
上课班级	金融工程 B22-2 (专升本)、金融工程 B21-1 (专升本) 金融工程 B22-1、金融工程 B22-9 辅修	班级人数	88	上课教室	二教 107、二教 302
答疑安排	周三第 1、5、6、7 节 (金融工程 B22-1 金融工程 B21-1 (专升本)) ; 周五第 4、5、6、7 节 (金融工程 B22-2)				
课程号/课程网站					
选用教材	沈沛龙主编《金融工程学》，中国金融出版社，2023 年 2 月第 2 版				
参考教材与资料	<p>参考书目</p> <p>【《金融工程学理论与实务》(第 3 版)，谭春枝 王忠玉 唐菁菁主编，北京大学出版社，2018 年 2 月第 3 版】</p> <p>【《金融工程学》(第四版)·叶永刚、彭红枫主编，东北财经大学出版社·出版社，2018 年 8 月第 4 版】</p> <p>【《金融工程》理论·实务·案例周玉红主编，机械工业出版社，2016 年 1 月第 1 版】</p>				

二、课程教学进度安排

课次	课时	教学内容	教学方式	作业
1		第一单元 金融工程概述	课堂讨论;直	教材 35 页

	3	1.1 金融工程的定义 1.2 金融工程风险案例 1.3 金融工程技术的应用	接讲授	练习题 1、2
2	3	第二单元 远期合约及其定价 2.1 远期和期货的发展; 2.2 互换市场的发展	案例教学;协 同教学	教材 56 页 练习题 1、3
3	3	第二单元 远期合约及其定价 2.3 期权市场的发展; 第三单元我国的衍生产品发展 3.1 中国市场的风险管理需求	课堂讨论;直 接讲授	教材 56 页 练习题 4
4	3	第三单元主要远期合约 3.1 商品远期 3.2 利率远期 3.3 外汇远期	案例教学;协 同教学	教材 81 页 练习题 1、2
5	3	第四单元 主要远期合约及其应用 4.1 远期合约定义、要素; 4.2 远期合约的种类	课堂讨论;直 接讲授	教材 81 页 例题 3
6	3	第四单元 远期工具的应用策略 4.3 远期工具的套期保值策略 4.4 远期工具的投机策略	案例教学;协 同教学	教材 98 页 练习题 1
7	3	第四单元 远期工具的应用策略 4.5 远期工具的套利策略	课堂讨论;直 接讲授	教材 98 页 练习题 1、3
8	3	第五单元 期货市场及期货定价 5.1 期货合约 5.2 期货价格期货市场	案例教学;协 同教学	教材 98 页 练习题 1、3
9	3	第五单元 期货市场及期货定价 5.3 期货价格 第六单元 主要期货合约 6.1 商品期货;	课堂讨论;直 接讲授	教材 121 页 练习题 2、3
10	3	6.2 利率期货; 6.3 外汇期货	案例教学;协 同教学	教材 149 页 练习题 1、2
11	3	第七单元 期货工具的应用策略 7.1 期货工具的套期保值策略;	课堂讨论;直 接讲授	教材 181 页 练习题 1、2

		7.2 期货工具的投机策略 7.3 期货工具的投机策略		
12	3	第八单元 互换合约及其定价 8.1 互换合约; 8.2 利率互换的定价与估值; 8.3 货币互换的定价与估值	课堂讨论;直接讲授	教材 121 页 练习题 1
13	3	第九单元 主要互换合约 9.1 商品互换; 9.2 利率互换; 9.3 货币互换	案例教学;协同教学	教材 228 页 练习题 1、2
14	3	第十单元 互换工具的应用策略 10.1 互换工具应用的理论基础; 10.2 互换工具的套期保值策略	课堂讨论;直接讲授	教材 121 页 练习题 1、2
15	3	10.3 互换工具的套利策略 第十一单元 期权概述 理论课时 11.1 期权合约; 11.2 期权市场; 11.3 期权价格	案例教学;协同教学	教材 264 页 练习题 1、2
16	3	第十二单元 主要期权合约 12.1 商品期权; 12.2 利率期权; 12.3 外汇期权	课堂讨论;直接讲授	教材 273 页 练习题 1

三、考核方式

总评构成	占比	考核方式
1	60%	期末闭卷
X1	10%	考勤
X2	10%	课堂提问
X3	20%	展示性小组讨论

任课教师：陈明

(签名)

系主任审核：

(签名)

日期：