

上海建桥学院课程教学进度计划表

一、基本信息

课程代码	2060363	课程名称	金融工程学
课程学分	3	总学时	48 学时
授课教师	陈明	教师邮箱	chennan7882@163.com
上课班级	金融工程 B20-2 (专升本)、金融工程 B20-1 (专升本) 金融工程 B21-1、金融工程 B21-2	上课教室	第一教学楼 207、第一教学楼 203、第一教学楼 309、
答疑时间	第 13 周		
主要教材	沈沛龙主编《金融工程学》，中国金融出版社，2019 年 8 月第 1 版		
参考资料	<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

周次	教学内容	教学方式	作业
1	第一单元 金融工程概述 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	课堂讨论;直接讲授 案例教学;协同教学	教材 35 页练习 习题 1、2
2	第二单元 远期合约及其定价 2.1 远期和期货的发展;	课堂讨论;直接讲授 案例教学;协同教学	教材 56 页练习 习题 1、3

	2.2 互换市场的发展		
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 案例教学;协同教学	教材 56 页练 习题 4
4	第三单元我国的衍生产品发展 3.2 中国市场的衍生产品; 3.3 课后习题	课堂讨论;直接讲授 案例教学;协同教学	教材 81 页练 习题 1、2
5	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 案例教学;协同教学	教材 81 页例 题 3
6	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	课堂讨论;直接讲授 案例教学;协同教学	教材 98 页练 习题 1
7	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 案例教学;协同教学	教材 98 页练 习题 1、3
8	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	课堂讨论;直接讲授 案例教学;协同教学	教材 98 页练 习题 1、3
9	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 案例教学;协同教学	教材 121 页 练习题 2、3
10	6.2 利率期货; 6.3 外汇期货	课堂讨论;直接讲授 案例教学;协同教学	教材 149 页 练习题 1、2
11	第七单元 期货工具的应用策略	课堂讨论;直接讲授 案例教学;协同教学	教材 181 页 练习题 1、2

	<p>7.1 期货工具的套期保值策略；</p> <p>7.2 期货工具的投机策略；</p> <p>7.3 期货工具的投机策略</p>		
12	<p>第八单元 互换合约及其定价</p> <p>8.1 互换合约；</p> <p>8.2 利率互换的定价与估值；</p> <p>8.3 货币互换的定价与估值</p>	<p>课堂讨论；直接讲授 案例教学；协同教学</p>	<p>教材 121 页 练习题 1</p>
13	<p>第九单元 主要互换合约</p> <p>9.1 商品互换；</p> <p>9.2 利率互换；</p> <p>9.3 货币互换</p>	<p>课堂讨论；直接讲授 案例教学；协同教学</p>	<p>教材 228 页 练习题 1、2</p>
14	<p>第十单元 互换工具的应用策略</p> <p>10.1 互换工具应用的理论基础；</p> <p>10.2 互换工具的套期保值策略；</p>	<p>课堂讨论；直接讲授 案例教学；协同教学</p>	<p>教材 121 页 练习题 1、2</p>
15	<p>10.3 互换工具的套利策略</p> <p>第十一单元 期权概述 理论课时</p> <p>11.1 期权合约；</p> <p>11.2 期权市场；</p> <p>11.3 期权价格</p>	<p>课堂讨论；直接讲授 案例教学；协同教学</p>	<p>教材 264 页 练习题 1、2</p>
16	<p>第十二单元 主要期权合约</p> <p>12.1 商品期权；</p> <p>12.2 利率期权；</p>	<p>课堂讨论；直接讲授 案例教学；协同教学</p>	<p>教材 273 页 练习题 1</p>

	12.3 外汇期权		
--	-----------	--	--

三、评价方式以及在总评成绩中的比例

总评构成 (1+X)	评价方式	占比
1	期末闭卷考	60%
X1	出勤	10%
X2	课堂提问	10%
X3	展示性小组讨论	20%

任课教师： 陈明

系主任审核： 日期：



2023. 2. 12