

III 커리큘럼

구분	과목	주요 주제	시간
금융공학이론	과정소개	교육일정 및 과정소개	1
	금융통계	금융시계열 및 계량분석	6
	금융수학	이항모형의 이해 및 실습, Brownian Motion의 이해 Ito Calculus, Risk Neutral Pricing, Martingale	20
	금융프로그래밍	Monte-Carlo Simulation, FDM, Excel VBA programming	12
	파생상품회계	ISDA 이해, 파생상품의 회계처리	7
파생상품별 운용/투자전략	주식 및 주식파생	BS 모형의 이해, 변동성모형	6
		ELS 가격결정 및 hedging의 이슈	6
	이자율 및 이자율 파생	채권론 및 한국채권시장의 특성	6
		이자율 기간 구조 및 이자율 모형	4
		이자율 스왑 평가, 크로스 스왑(CRS)의 평가	6
	신용 및 신용파생	신용모형, 신용파생상품	4
		CLN의 구조 및 특징	2
	외환 및 외환파생	FX 시장의 특징 및 구조	4
		Case study	4
	현장적용실습 프로젝트	Business Clinic	팀과제 수행 ⇨ 보고서 작성 ⇨ 발표 ⇨ 지도교수 평가
연구보고서 발표			4
평가	중간/기말		3
특강	전문가 특강	국내외 저명인사의 특강	2
합계			100

개강식	과정 소개 등	3. 31
워크샵(2회)	1박 2일	4. 18 ~ 19 (예정)
	1일	5. 31 (예정)
팀 프로젝트	팀과제 관련 토론 병행	수시
수료식	성적 우수자 시상, 수료증 수여	7. 9

\* 상기 내용은 사정에 따라 일부 변경될 수 있음