

上海财经大学 2021—2022 学年第 1 学期教学进度表

统计与管理学院学院 金融统计与风险管理 专业 2018 年级 1、2 班 课程名称 数量金融

总课时 36 本学期安排课时数 36 (其中讲课 34 课时, 习题讲解、讨论 2 课时, 其他 课时)

讲课教师 卞世博 辅导教师

课程代码 102039 课程序号 0304、0322 讲课教师 卞世博

周次	月/ 日~ 月/ 日	讲 课		课堂练习、讨论及课外作业	
		时数	内 容	时数	内 容
1	9.8	2	第一讲 数理金融导论 第一节 数理金融概述 第二节 金融市场概述		
2	9.15	2	第一讲 数理金融导论 第三节 金融衍生产品概述 第四节 数理金融的核心问题		
3	9.22	2	第二讲 数理金融预备知识 第一节 无套利均衡分析法 第二节 收益率与波动率		作业 1
4	9.29	2	第二讲 数理金融预备知识 第三节 随机微积分	0.5	习题讲解 作业 2
5	10.6	2	第三讲 期权和期权交易策略 第一节 期权的定义与种类 第二节 期权回报与价格分析	0.5	习题讲解
6	10.13	2	第三讲 期权和期权交易策略 第三节 期权交易策略		作业 3
7	10.20	2	第四讲 BS 期权定价模型 第一节 BS 期权定价模型的基本思路	0.5	习题讲解
8	10.27	2	第四讲 BS 期权定价模型 第二节 BS 期权定价公式 第三节 BS 期权定价公式的精确度评价与拓展		作业 4
9	11.3	2	第五讲 希腊字母和对冲 第一节 Delta 第二节 Gamma 第三节 Vega	0.5	习题讲解

周次	月/ 日~ 月/ 日	讲 课		课堂练习、讨论及课外作业	
		时数	内 容	时数	内 容
10	11.10	2	第六讲 希腊字母和对冲 第四节 Theta 第五节 Rho		
11	11.17	2	第五讲 二叉树定价模型 第一节 单期二叉树模型 第二节 多期二叉树模型		
12	11.24	2	第五讲 二叉树定价模型 第三节 美式期权定价		大作业
13	12.1	2	第七讲 奇异期权 第一节 亚式期权 第二节 障碍期权 第三节 回溯期权和呐喊期权		
14	12.8	2	第七讲 奇异期权 第四节 篮子期权 第五节 两值期权 第六节 其它奇异期权		
15	12.15	2	第八讲 利率期限结构与随机利率模型 第一节 利率期限结构 第二节 随机利率		
16	12.22	2	第八讲 利率期限结构与随机利率模型 第三节 随机利率模型 第四节 互换与零息债券的关系		
指定教材和教学参考书			指定教材：保罗 威尔莫特：《数量金融》第二版，机械工业出版社，2015 年。 参考书目：约翰 赫尔：《期权、期货和其他衍生产品》，华夏出版社，2004 年。		

注：如遇节假日，课程进度安排将进行相应调整或顺延。

注：本表一式四份，一份送教研室，一份送讲课班级，一份送教务处，一份讲课教师自留。

系主任_____