

# 教 学 日 历

2007 ~2008 学年度第 二 学期

教师姓名		叶永刚		职 称		教授			
课程名称		金融工程		课程性质		实践教学环节			
授课方式		课堂教学		考试方式		报告与笔试相结合			
教 材		《金融工程概论》		出版社		武汉大学出版社			
授课 年级	2005 级	授课 专业	金融工程	人数	69	学时	18	周学 时	3 学 时
周 次	日 期	授 课 内 容							
第 1 周									
第 2 周									
第 3 周	3.22	VaR 度量的方法							
第 4 周									
第 5 周	4.5	国债的市场风险分析							
第 6 周									
第 7 周									
第 8 周	4.26	Creditmetrics 模型的应用							
第 9 周									
第 10 周	5.9	ANP 在操作风险评级中的应用							
第 11 周									
第 12 周	5.23	极值理论在操作风险度量中的应用							
第 13 周									