수업계획서

2024학년도 1학기 금융통계 전공필수(전공선택)

2021-	10-171	08671						COST(COC7)		
교과구분		전공필수(전공선택)			소속	속	통계학과			
	교과번호(분반)	47743(01)		성당		 병	김성곤			
		705-11/6	\	담당 연락		 '처		2636		
기본	교과목명(영문명) 금융통계(Statistical Finance)		Olulo			sakin	n@uos ac kr			
기근	학점(시간)	3학점(3시간)		교수	71-11-2		sgkim@uos.ac.kr			
정보	강의실 습구분	강의			홈페이지					
	수업시간(강의실)	화[2,3]/33-607,목[6]/33-607		조교	상담시					
	 개설학년	2 시즌타크		25.116	담당조교(연락시)				
	기골막진 집중수업구분	3, 4학년								
성적	평가방법			상대평가						
	■ 출석 (10%)	□ 학생포트폴리오 (0%)			□ 참여도 (0%)					
평가				□ 중간과제 (0%) ■ 중간시험 (35%)						
	□ 기말과제 (0%)	■ 기말시험			[타(0%)	□OH÷	L			
	수업유형	■일반 □블렌디드러닝	□PBL □S	외국어		□융복합	Ī	□서비스러닝		
	강의유형 대면(오프라인) 100 % 비대면(온라인) 0 %									
		중간고사	대면■ 비대면□ 없음□							
	시험유형	SCON THE THE WALL					퀴즈, 수시고사 등)	대면■ 비대면□		
Mallo		기말고사 대면圖 비대면□ 없음□				· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·				
		■강의	■발표 □	토론		□실험				
	수업방법	□실습	□실기 □성	설계		□견학				
		□프로젝트	□이러닝(e-learning)							
'표절'이란 타인의 글을 적절한 인용 및 참고문헌 표기 없이 자기가 쓴 것처럼 표절금지규정 도덕적 양심을 저버리는 잘못된 행위입니다. 표절한 보고서를 제출하거나 표						행사하는 것으로서 E절한 자료를 사용하	 하여 발표한 경우			
		정도에 따라 감점 :	처리하며, 심할 경우 0점으	로 처리	합니다.					
			H(장애학생지원실, 02-64	90-627	3)의 도 움을 받	받아 필요한	<u>.</u> 사항에			
-110	게 담당 포구와 업의,조	강일 구 있답니다.								
교과목 설명						교과목 목표 역량				
					전공능력			력 대표성		
					통계적모형화			전공능력		
					협업 프로그래밍		연관	전공능력		
	이 과목은 금융의 기본적인 용어 및 이론을 소개하고, 이러한 이론을 금융자료에									
하기 위한 통계적 방법론을 소개하는 것을 목적으로 한다. 금융이론은 최근에 비					수리 통계윤리					
발전을 이루었으며, 현대적 투자론의 근간을 이루었고, 이론이해 및 실무적용 능				5력에	문제해결					
대한 사회적 수요가 더해가고 있기 때문이다.				자료처리						
			-	자료분석						
					글로벌					
수업목표					교재내용					
금융이론은 최근에 비약적인 발전을 이루었으며, 현대적 투자론의 근간을 이룬 다. 이론이해 및 실무적용 능력에 대한 사회적 수요가 더해가고 있다. 본 교과에				교재: 프	교재: 프린트					
다. 이론이해 및 실무적용 능력에 대한 사회적 수요가 더해가고 있다. 본 교과에 되었는 그음이 기보점이 요이 미 이름은 스케팅을 이고함 이름은 그은 기본에 된				참고문	참고문헌:					
[시근, 급형의 기본적인 용어 및 이논을 조개하고, 이디안 이논을 급형자료에 작 [요하기 이해 토게저 바버로의 스케하다]				1. Davi	1. David Ruppert, Statistics and Finance, Springer					
04/11/C0/11/10/11/24/11/24/11/24/11/24/11/24/11/24/11/24/11/24/11/24/11/24/11/24/11/24/11/24/11/24/11/24/11/24					2. Peter F. Christoffersen, Elements of Financial Risk Management					



주	수업내용	수업방법	교재	준비물,과제,기타
1	수익률, 임의보행과정 모형	강의		
2	효율적 시장가설	강의		
3	포트폴리오 이론: 평균-분산 모형	강의		
4	포트폴리오 이론: 평균 분산 모형	강의		
5	자본자산 결정모형 (CAPM)	강의		
6	자본자산 결정모형 (CAPM)	강의		
7	· 실물자산의 수익률자료로부터, 최적의 포트폴리오를 구성할 수 있도록 한다. · 코스피에 상장되어 있는 종목 중 몇 개를 선택하여, 기대수익률, 수익률의 분산, 공분산을 추정하고, 이를 이용하여, 최적포트폴리오를 구성해보고, 이를 발표한다. · 적절한 수의 팀으로 나누어, 팀당 20분 발표 5분 토론의 형식으로 진행한다.	발표		
8	중간고사	시험		
9	변동성 모형	강의		
10	변동성모형	강의		
11	위험값의 추정: 모수적 방법	강의		
12	보강주간			
13	위험값의 추정: 비모수적 방법, 몬테카를로 방법	강의		
14	위험값의 추정 방법 검정	강의		
15	· 실물자산 및 옵션으로 이루어진 포트폴리오의 최적투자방법 및 VaR 을 추정하는 내용의 팀별 발표를 한다. · 적절한 수의 팀으로 나누어, 팀당 20분 발표 5분 토론의 형식으로 진행한다.	발표		
16	기말고사	시험		