

## 教育プログラムの概要及び採択理由

機 関 名	一橋大学	申請分野(系)	人社系
教育プログラムの名称	文系修士課程における金融工学教育モデル		
主たる研究科・専攻名	経済学研究科経済理論・経済統計専攻		
(他の大学と共同申請する場合の大学名、研究科専攻名)			
取 組 実 施 担 当 者	(代表者) 斯波 恒正		
<p>[教育プログラムの概要]</p> <p><b>現在までの取り組みと可能な波及効果：</b> 本研究科では平成17年度に、その数学的・工学的な性質から文系の大学院では実施が困難視されていた金融工学・計量ファイナンスの修士レベルの教育システム（「統計・ファイナンスプログラム」）を本格稼働させた。高度に数理工学的である点や、社会人を対象としたものでない点等、既存の社会人を対象とした文系MBAとは大きく異なっている。2年間で10人の修了者を、理系学位を持つ者が殆どである金融機関の最先端の職場に供給している。金融工学の現場としても、経済学という社会科学の見方ができる人間を得ることで人材の多角化が実現する。また、本研究科のこうした取り組みは、経済学の基礎に立つ金融工学の高度専門職業人教育を行う先駆的な教育モデルとして、他の文系の大学院にも少なからず影響を与えてきた。</p> <p><b>本教育プログラムの提案内容：</b> 本提案は、現在まで順調に運営してきたこの金融工学教育を、より充実させ新たな分野へ発展させることで、文系の大学院において高度な理系教育を行う教育モデルとして確立させ、世界の同様な試みに比肩し得るものにするを狙う。</p> <p>[1] 教育環境の充実と授業系列の一層の整備を行い、金融工学・計量ファイナンスの教育拠点としての位置を確固たるものにする。</p> <p>[2] 金融工学・計量ファイナンスの教育が文系の修士にとっても魅力があることを大学関係のみならず社会に広く訴える。このことで、より多くの優秀な学生を集め、また金融工学教育に対する社会的認知度の高まりを図る。</p> <p>具体的には、[1]において資産選択理論の数理的基礎である数理計画法の授業を開設し、近年需要の高まりを見せる生保・損保・年金の数理的側面を扱うアクチュアリー関係の授業体系を整備する。なお、上記10人の中には難関のアクチュアリー資格試験の幾つかに合格した者が既に2人いる。まず保険数理と年金関係の授業を開講し、最終年度に「アクチュアリー・コース」を開設する。[2]に関しては、修士入学者だけでなく、学部入学者にも金融工学教育（上記の「統計・ファイナンスプログラム」）の周知を徹底するため、内外の金融工学の専門家を招いてシンポジウムを開催する。また、より多くの成績優秀な学生を本プログラムにリクルートするために、彼らの教育・研究環境の整備を進める。</p>			

履修プロセスの概念図（履修指導及び研究指導のプロセスについて全体像と特徴がわかるように図示してください。）



統計学、計量経済学、計量ファイナンス、保険数理を専門とする教授陣による充実のカリキュラム

	科目区分	授業科目
2 年 次	専門科目	計量ファイナンスB、ファイナンス経済論B(数理ファイナンス2)、 情報処理論B、計量ファイナンス特論(保険数理)
	演習・実践演習	大学院演習(主ゼミ)、インデペンデント・スタディー
	ワークショップ	ワークショップ
1 年 次	基礎科目	計量ファイナンスA、金融経済論Ⅱ、計量経済学特論(計量ファイナンス)、情報処理論A
	専門科目	ファイナンス経済論A(数理ファイナンス1)、 計量ファイナンス特論(リスク評価とヘッジ手法)、応用数理
	コア科目	中級計量ファイナンス、上級計量経済学Ⅰ

金融工学の専門家を志す優秀な学部卒業生

<採択理由>

大学院教育の実質化の面では、「金融工学の専門家の養成」という、社会のニーズに対応した人材養成目的が明確に掲げられており、それに沿った金融工学や計量ファイナンスなど、体系的な教育課程の編成がなされ、その展開のための充実した指導体制が整備されている点は高く評価できる。しかし、教育活動の質の向上や改善を図るためのファカルティ・ディベロップメントの展開については、研究科・専攻として組織的に推進するための体制の整備が必要であるので、なお一層の工夫が望まれる。

教育プログラムについては、金融工学の専門的知識の体系的学習を目指す教育プログラムとなっており、「文系大学院学生に金融工学の能力を身につけさせる」という人材養成目的を具現化するため、特に金融工学教育の取組が計画されている点は高く評価できる。これまでに統計・ファイナンスプログラムの教育に取り組んできた実績からみても、その現実性、実効性が期待できる。ただし、総合的判断力を養成するためにも、倫理やコンプライアンスなどについても教育していくことが必要であり、教育課程の編成に更なる工夫が望まれる。