

2025年 目程

土曜午後 2時40分～5時50分 (休憩10分: 90分の2コマ)

1. 11/29 Ibor スワップ、RFR スワップ
2. 12/6 アセットスワップ、Z スプレッド、物価連動債、インフレスワップ
3. 12/13 クレジット・デフォルト・スワップ (CDS)
4. 12/20 Black モデル、Normal モデル、インプライド・ボラティリティ (IV)
5. 1/10 スワップション、SABR モデル、Cap, Floor,
6. 1/17 Hull-White モデル、ツリーとアメリカン モンテカルロ
7. 1/24 VIX、バリアンススワップ
8. 1/31(3限のみ) ポートフォリオ、VaR (未定)

=====

期末試験は行わない為、主に出席と宿題の提出回数(%)で成績を評価

- ・ 66%以上の提出と取り組み積極性で 1番目の評価 : 5
- ・ 33%以上の提出した方は 2番目の評価 : 4
- ・ 10%以上の提出した方は 3番目の評価 : 3
- ・ 宿題を提出しなかった方は 4番目の評価 : 2

=====

出席が3回以下の場合 : 1

=====

Memo

前期I : 4 - 6月上旬 前期II : 6月上旬 - 8月上旬

後期I : 10 - 11月 後期II : 12月 - 2月上旬

開講時間割り : 月--金 :

5限 18:20 - 19:50 6限 20:00 - 21:30

土曜 :

1限 10:30 - 12:00 2限 13:00 - 14:30 3限 14:40 - 16:10 4限 16:20 - 17:50

【宿題】

#01 対数線形補間

(1) Anaconda と QuantLib をインストールし、テキスト 23 ページ図 1.17 を実行

(2) Excel で図 1.17 と同じ値を算出

上記(1)と(2)のスクリプトを提出

#02 TONA スワップのフェアレートとデイリーコンパウンド

(1) QuantLib の図 3.5(p.85)を再現し、Bloomberg の計算と比較

(2) 図 3.6(p.85)のフェアレートをエクセルで計算

(3) 図 3.7(p.87)を経由し、デイリーコンパウンドでフェアレートを計算