

## 2025 年 日程

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、バリエーションスワップ
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)のスクショを提出

### #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