* Exercise1.3

【解答】：柳澤

テキスト式1.2(P2)より

|  |  |
| --- | --- |
|  | (1.2) |

テキスト式1.6(P6)より

|  |  |
| --- | --- |
|  | (1.6) |

以上の2式から

|  |  |
| --- | --- |
|  |  |

この関係式をもとにについて解く

|  |  |
| --- | --- |
|  |  |

* Exercise1.9

において，（）のco-initialスワップレートを所与とし，を再帰的に求める．

【解答】：柳澤

テキスト式1.15(P12)より，

1. のとき

|  |  |
| --- | --- |
|  | (1.15) |

となるため，

|  |  |
| --- | --- |
|  |  |

より，であるから

|  |  |
| --- | --- |
|  |  |

1. のとき

|  |  |
| --- | --- |
|  | (1.15) |

これをについてまとめると，

|  |  |
| --- | --- |
|  |  |

より，であるから

|  |  |
| --- | --- |
|  |  |