

マルチカーブによるイールドカーブ構築方法

現在の市場系リスク管理業務では、有担保および無担保のデリバティブ契約に対して、それぞれ異なるイールドカーブで評価する事が常識となっている。加えて、デリバティブの原資産である金利の通貨と、デリバティブ契約に対する担保の通貨が異なる場合でも、適切なイールドカーブで評価する事が求められている。(マルチカーブ対応)

本研修では、円金利にフォーカスして、マルチカーブによる金利デリバティブの評価を、Excel や C/C++等で数値例を示しつつ、実務に則した具体例で解説する。また Excel 等で演習を行い、知識の定着も図る。

実施スケジュール

日程・時間	内容
2018年10月2日 19:00-21:00	金利スワップ、金利先物/先渡、Cap/Floor、Swaption等の単一通貨での金利デリバティブの解説と数値例を確認する。またExcelでの数値演習も行い、理解を深める。
2018年10月9日 19:00-21:00	通貨スワップ、為替先物/先渡、通貨デリバティブ等のOTCデリバティブの解説と数値例を確認する。またExcelでの数値演習も行い、理解を深める。
2018年10月16日 19:00-21:00	円金利マルチカーブ (OISイールドカーブ、LIBOR6Mカーブ、LIBOR3Mカーブ) を構築する。またBPV、GPS等の金利リスク算出も演習する。
2018年10月23日 19:00-21:00	ドル担保円金利マルチカーブ (OISイールドカーブ、LIBOR6Mカーブ、LIBOR3Mカーブ) を構築する。

会場

JAビル カンファレンス 303
東京都千代田区大手町 1-3-1
<https://www.zenchu-ja.or.jp/conference>



受講料

全4回 80,000円(税別)

講師紹介



長谷川 貴博 (シニアクオンツアナリスト/CEO) 1979年10月生まれ。

富士通株式会社にて金融エンジニア、みずほフィナンシャルグループにてクオンツ・アナリスト、株式会社Sound-F(現Sound-FinTech)の金融工学部門の責任者を歴任。2015年に株式会社オメガ・パートナーズ創業。クオンツ歴13年。

領域：数理モデル、リスク計算、数値検証、数値解析(C/C++、Java)
東北大学(理・数・修了)、著書「AI化する銀行」、数理ファイナンス論文多数

お問い合わせ

〒100-0004 東京都千代田区大手町 1丁目 5-1 大手町ファーストスクエア イーストタワー4F
株式会社オメガ・パートナーズ
03-5219-1421
info@omegapartners.jp