

Zoom セミナー

経理・財務担当者のための 通貨オプション取引入門(Excel 編)

もりやひろゆき

講師 **森谷博之氏**

Quasars22 Private Limited(Singapore)
Director, MBA, MBA, MSc,

日時 2020年9月10日(木) 午前10時00分~12時00分

■このセミナーは Zoom でご受講いただけます。お申し込み後に詳細をメールでお送りします。

為替リスクのヘッジに欠かせないのがオプション取引です。為替レートの予測は経済・金融市場の中でもっとも難しいものの1つです。コールとプットと呼ばれるオプション取引は保険と同じ機能を果たし、リスク回避には欠かせない道具です。その機能はペイオフとして表現されます。為替レートの上昇時には上値を追い、下落時には損失を限定するペイオフは、店頭・上場オプションを取引することでも得られます。本セミナーではオプションの基本知識を得たうえで、エクセルでブラックショールズモデルを用いてオプションの価値を計算したり、FRED から実データをダウンロードして、オプション取引を疑似体験したりします。そのような実データを用いた疑似取引体験はオプション市場の理解を深めます。

1. ブラックショールズモデルと通貨オプション市場入門
2. FRED からのデータのダウンロード
3. ヒストリカルボラティリティーの算出とオプション価格の算出
4. インプライドボラティリティーの算出とオプション価格
5. 実データと疑似データを用いたオプション取引

■目標: ブラックショールズモデルの理論的な背景を理解した後に、実データを用いてオプション市場の本質を理解する。

■受講対象者: 為替ヘッジ、オプション理論、為替オプション市場に興味のある方であれば誰でも参加可能です。

■PCには事前にExcelがインストールされている必要があります。また、米国FEDが提供するAPIを事前にインストールする必要があります。これにより為替レートのダウンロードが可能になります。Qiitaの記事をご覧ください。

参考文献:

外国為替オプションの理論(東洋経済)
エクセルで世界の経済データをダウンロード

<https://qiita.com/innovation1005/items/d6c75baa3a38b7f1a7e5>

【講師紹介】 Quasars22 Private Limited(Singapore), Director, MBA, MBA, MSc。主な論文に「金融市場の安定、多重性の増加、取引戦略の役割」企業研究第30号(2016年3月)、「シンガポールの金融ビジネスの可能性とそれを支えるシステム」企業研究第29号(2015年8月)がある。主な訳書に「シュワッガーのテクニカル分析」(1999、パンローリング)、「物理学者ウォール街を往く」(2005、東洋経済新報社)。

■主催 **金融財務研究会**
<https://www.kinyu.co.jp>

Facebook: <https://www.facebook.com/keichoken>
Twitter: <https://twitter.com/keichoken05>
Blog: <https://www.kinyu.co.jp/blog/>



開催日

2020年9月10日(木)
10:00~12:00

本セミナーは Zoom で開催いたします。
インターネットに繋がるパソコンがあれば、どこでも受講できます。
参加費をお振込いただいた後に、メールで詳細をお送りいたします。

参加費

1名につき25,000円(消費税、参考資料を含む)
1社2名以上同時に参加お申込みいただいた場合、お2人目から
1名につき22,000円になります。
追加申込みの場合はその旨をご記入下さい。

申込先

金融財務研究会 ホームページ <https://www.kinyu.co.jp/>
〒103-0025 東京都中央区日本橋茅場町1-10-8 グリンヒルビル
TEL 03-5651-2030 FAX 03-5695-8005

申込方法

ファックス又は郵便にて参加申込書をお送り下さい。上記ホームページの申込欄からもお申込いただけます。折り返し、受講証と請求書を郵送致します。参加費は下記の普通預金口座に開催日前日までにお振込み下さい。(但し経理の都合等で間に合わない場合は、ご連絡いただければお待ちいたします。)参加費の払戻しは致しませんので申し込まれた方がご都合の悪い時は代理の方がご出席下さい。又当日ご参加になれなかった場合、当社および経営調査研究会主催の他のセミナーに無料でご出席いただけます。(但し新しいセミナーの参加費との差額が2,000円以上の時は差額をお支払いいただきます。また、振替は1年以内にお願いたします。)ご記入いただきました個人情報、当社および関係会社の受講者名簿の整備や今後開催されるセミナーのご案内等に使用します。

振込口座

普通預金 口座名 (株)金融財務研究会

三菱UFJ銀行	本店	1642356	三井住友銀行	本店営業部	7397637
三菱UFJ信託銀行	本店	2818151	みずほ銀行	東京営業部	1427715
三井住友信託銀行	本店営業部	2993982	りそな銀行	東京営業部	1693669

----- 切らずにこのままお送り下さい -----

経理・財務担当者のための

通貨オプション取引入門 (Excel編) **【Zoom】**

9 / 10

参加申込書

FAX 03-5695-8005

年 月 日

ご連絡・講師へのご質問等ご記入下さい	会社名	E-Mail		TEL
	所在地	〒		FAX
	参加者ご氏名		部課名	
	〃		〃	
	〃		〃	
	〃		〃	
	書類送付先 (同上の場合記入不要)	ご担当者	部課名	
*セミナーコード 1691 (Inv-k201691)	TEL	FAX		

お申込の翌日には「受講証・請求書」を発送しておりますが、お手元に届かない場合は、弊社までご連絡下さい。