

Zoom セミナー

エキゾチックオプションの評価入門(Excel 編) 午後の部

もりやひろゆき

講師 **森谷博之氏**

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

日時 2022年8月31日(水) 午後1時30分~4時30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。

本セミナーではエキゾチックオプションの評価について学びます。このようなモデルは様々な場面で応用が可能です。アクティブトレード戦略の評価、リアルオプションの評価などでは、時間をずらす、延長する、突然消滅する、価格の最大値と最小値、平均など将来のペイオフと関連しそうな要素が無数にあります。本セミナーではこのような要素に関連するエキゾチックオプションの評価を丁寧に学び、応用力を身に着けます。

1. フォワードスタートオプション、満期延長オプション
2. タイムスイッチオプション
3. ルックバックオプション
4. アジア型オプション
5. バリアオプション

■目標

ブラックショールズモデルの理論的な背景を前提に、エキゾチックオプションの評価を理解します。また、その応用を理解します。各種エキゾチックオプションの使い方がわかります。

■受講対象者

オプション理論、通貨オプション、株式オプション、ヘッジ取引、リアルオプションに興味のある方であればどなたでも参加可能です。基本的なオプション取引の知識を身に着けた人を対象としています。基礎的なアメリカンオプションの理論と評価は午前の部で行います。

■PCには事前に Excel、Excel VBA がインストールされている必要があります。

参考文献：

Option pricing formulas by Haug

Python3 ではじめるシステムトレード：ブラック-ショールズ方程式を理解する

<https://qiita.com/innovation1005/items/98e28dd0e38246d1dbac>

フィナンシャルエンジニアリング by ジョンハル(きんざい)

【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)。

※録音・録画はご遠慮下さい。

■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

2022年8月31日(水)
13:30~16:30

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。
原則として、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35,400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30,000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。本セミナーは午前と午後の部があります。午前・午後一括お申込みの
場合は、午後のセミナーが30,000円の特別料金となります。

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

上記ホームページの申込欄からお申し込み下さい。参加申込書を FAX 又は郵送
いただいております。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。) クレジットカー
ドご利用の場合は、質問欄にその旨をご連絡下さい。参加費の払戻しは致しません
ので、当日ご参加になれない場合は、代理の方のご出席あるいは当社および金融財
務研究会主催の他のセミナーへのお振替をお願いします。(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(セミナーの開催のために使用させていただきますが、漏洩などが
ないよう最善の予防、是正に努めます。詳しくは弊社ホームページをご覧ください。)

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

◇クレジットカードは Visa、Mastercard、American Express、JCB、Diners Club、
Discover がご利用いただけます。

----- 切らずにこのままお送り下さい -----

エキゾチックオプションの評価入門
(Excel編)【Zoom】 8/31

参加申込書

FAX 03-5695-8005

2022年 月 日

ご連絡・講師へのご質問等ご記入下さい	会社名	TEL FAX		
		E-Mail		
弊社からのお知らせ、メルマガの送信を <input type="checkbox"/> 受信する <input type="checkbox"/> 受信しない クレジットカードをご利用の場合は下記に✓を入れて下さい。 <input type="checkbox"/> クレジットカード利用	所在地	〒		
	参加者ご氏名		部課名	
	〃		〃	
	〃		〃	
	〃		〃	
セミナーコード 1623 (Inv-k221623)	書類送付先 (同上の場合記入不要)	ご担当者 TEL	部課名 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。