

回覧				
----	--	--	--	--

Zoom セミナー

2項ツリーとモンテカルロ法を用いたオプション価格入門(Excel 編)

もりやひろゆき

講師 **森谷博之氏**

オックスフォードファイナンシャルエデュケーション
Director, MBA (Strath), MBA (HW), MSc (London)

日時 2024年4月12日（金）午前9時30分～12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2項ツリーとモンテカルロ・シミュレーションを用いたオプションの価格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。本セミナーではヨーロピアンオプションとアメリカンオプションの評価に利用します。さらに応用力を付けるために最小二乗モンテカルロ法についても学びます。

1. 組み合わせ、順列、2項分布：2項ツリーモデル入門
2. 乱数の発生とその精度：モンテカルロ・シミュレーション入門
3. ヨーロピアンオプションとアメリカンオプションの評価：
2項ツリーとモンテカルロ法の比較
4. 最小二乗モンテカルロ法：計算速度と精度の向上

■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、ヨーロッパ型、アメリカ型のオプションのモデル化を理解します。また、その応用を理解します。

2項モデル、モンテカルロ・シミュレーションなど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い人を対象としています。

■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。

■本セミナーは事前に講師とメールで打ち合わせを行います。そのため、講師にメールアドレスを開示させていただきます。ご了承の上お申込みいただきますようお願いいたします。

参考文献：

Option pricing formulas by Haug

ファイナンシャルエンジニアリング by ジョンハル

Valuing American Options by Simulation: A simple Least-Squares Approach
by Longstaff and Schwartz

【講師紹介】オックスフォードファイナンシャルエデュケーション, MBA (Strath), MBA (HW), MSc (London). 国際機関、金融機関で勤務後、大学での教育活動に従事。実務家向けセミナー多数。主な訳書「物理学者ウォール街を往く」（東洋経済新報社）。主な著書「Python3 ではじめるシステムトレード改訂版」（パンローリング）

※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

2024年4月12日（金）
9：30～12：30

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35,300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。

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は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

2 項ツリーとモンテカルロ法を用いた
オプション価格入門（Excel 編）

【Zoom】 4 / 1 2

参加申込書

FAX 03-5695-8005

2024年 月 日

ご連絡・講師へのご質問等ご記入下さい 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	会社名	TEL FAX		
	所在地	E-Mail 〒		
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	参加者ご氏名	部課名		
	〃	〃		
	〃	〃		
セミナーコード 1021 (Fin-k241021)	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。