

同志社大学

2013年度 個人研究費研究経過・成果報告書

2014年2月10日提出

所 属	職 名	氏 名
経済学部	教授	久保 徳次郎
研 究 題 目	金利スワップ取引とスワップ・レートの決定	
研 究 成 果 の 概 要	<p>本年度は、フォワード・レートを使って固定金利の基準レートとなるスワップ・レートを求める研究を行った。そして、このスワップ・レートを使ってマルチ資産オプション価格の評価を試みた。この研究成果の一部は下記の論文の形で公表の予定である。</p> <p>「マルチ資産オプションの数値計算法—多次元2項ツリー・モデル—」『経済学論叢』（同志社大学経済学会）65巻4号, 2014年3月（掲載予定）</p>	