

# 同志社大学

## 2011年度 個人研究費研究経過・成果報告書

2012年 3月 31日提出

所 属	職 名	氏 名
経済学部	教授	久保 徳次郎
研 究 題 目	マルチ原資産オプション価格の数値計算法	
研 究 成 果 の 概 要	<p>多項式による回帰モデルを利用する Longstaff-Schwartz(2001)モデルでは、マルチ原資産オプションを評価する場合、原資産価格の間に相関関係がある場合には評価することができない。そこで独立的な原資産からなるオプション価格の評価モデルのプログラムの作成を行った。また、誤差項に1階の自己相関がある場合に対処するために、一般化最小二乗法や最尤法を利用するプログラムも同時に作成した。</p> <p>プログラムではデータの入力先と計算結果の出力先にはエクセルのワークシートを利用した。エクセルを使う場合、VBAをプログラム言語として利用するのが便利であるが、計算精度と速度に関しては Visual Basic Net 2010の方が優れているので、プログラムはすべてこの言語で作成している。</p>	