

GMS2014 (Global Market Solutions) 金融市場国際フォーラム
【登録フォーム】 <http://goodway.co.jp/fip/htdocs/event/gms2014/registration>
(GMS2014 運営事務局 : 株式会社グッドウェイ)

講演タイトル
「デリバティブ当初証拠金の計算モデルとプライシング」
講演者
Diva Analytics 代表取締役 高田 勝己 氏
講演概要
現在 JSCC や LCH で実装されている当初証拠金の計算方法の概要を示し、2015 年末から順次始まる予定である相対取引の当初証拠金計算方法の具体例を示したい。また、当初証拠金が CVA、DVA、FVA に与える影響について考察して、当初証拠金を織り込んだデリバティブの評価式を算出する。