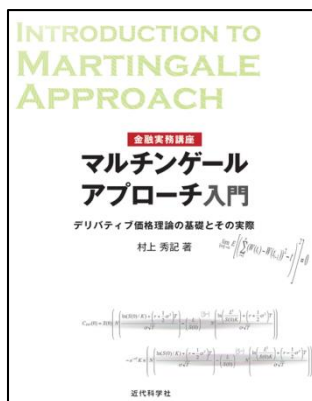


『金融実務講座 マルチンゲールアプローチ入門 —デリバティブ価格理論の基礎とその実際—』 発売

2015 年 7 月 9 日
株式会社近代科学社

インプレスグループで理工学分野の専門書出版事業を手掛ける株式会社近代科学社（本社：東京都新宿区、代表取締役社長：小山透）は、『金融実務講座 マルチンゲールアプローチ入門—デリバティブ価格理論の基礎とその実際—』を発売いたします。

『金融実務講座 マルチンゲールアプローチ入門—デリバティブ価格理論の基礎とその実際—』
<http://www.kindaikagaku.co.jp/business/kd0480.htm>



2015 年 7 月 14 日発売予定

定価 本体 3,700 円+ 税

著者：村上 秀記（横浜国立大学成長戦略研究センター 客員教授）

B5 変型判・256 頁

ISBN 978-4-7649-0480-4 C3033

デリバティブ価格理論の“至宝” !!

本書はマルチンゲール・アプローチと呼ばれる、無裁定に基づくデリバティブのプライシング方法を、実務家向けに解説した本である。マルチンゲール・アプローチは、単にデリバティブのプライシングのみならず、金融における数多くの問題の正確な記述と理解、そして解決に、実は欠かせないものになっている。このマルチンゲール・アプローチ本来の恩恵を行きわたらせたい、実務家には優秀なエンジニアではなく、まずは優秀なドライバーになって欲しい、と願って書いたのが本書である。

デリバティブ業務に携わる実務家に、“マルチンゲール・アプローチは使うだけならこんなに簡単で、実際の実務に大変役に立つ事に気付いて欲しい”、そして、“是非習得して日本の金融を強くして欲しい”、そんな筆者の長年の願いを込めて書いた本である。（まえがきより）

主要目次

第1章 マルチンゲール・アプローチによる Black-Scholes 式の導出

市場の設定

マルチンゲール・アプローチの概要

Black-Scholes の世界への基本定理の適用

株価のモデリングとブラウン運動

伊藤の公式

Black-Scholes 式の導出

ギルザノフの定理と色々な株価表現
ニューメレールの選択と測度

■章末付録

2 項モデルとマルチンゲール・アプローチ
ブラウン運動：対称ランダムウォークからの構成
2 次変分と伊藤の公式
対数正規分布について
指数化された正規分布の期待値
Black-Scholes 方程式の導出

第 2 章 エキゾチック・オプション

スプレッド・オプション
コンパウンド・オプション
クオント
バリアー・オプション

第 3 章 フォワード・メジャーとその応用

債券価格とフォワード・メジャー
フォワード・メジャーによるプライシング
フォワード・メジャーへの変換
応用例：金利キャップ
債券のプライシングについて
フォワードと先物
フォワード価格と先物価格の違い

■章末付録

為替のフォワード
ユーロ円金利先物の Timing Adjustment

巻末付録：確率論入門の入門 推薦図書

【株式会社 近代科学社】 [http:// www.kindaikagaku.co.jp](http://www.kindaikagaku.co.jp)

1959 年創立。情報工学・数理科学・電子工学関連の大学向け教科書を中心に理工学専門分野の出版事業を展開。

【インプレスグループ】 <http://www.impressholdings.com/>

株式会社インプレスホールディングス（本社：東京都千代田区、代表取締役：関本彰大、証券コード：東証 1 部 9479）を持株会社とするメディアグループ。「IT」「音楽」「デザイン」「山岳・自然」「モバイルサービス」を主要テーマに専門性の高いコンテンツ＋サービスを提供するメディア事業を展開しています。

【本件に関するお問合せ先】

株式会社近代科学社 担当：営業部

Tel : 03-3260-6161 / E-mail : sales-corporate@kindaikagaku.co.jp