

## 課題 5

2016/11/17

- (I) 過去に契約した想定元本 10,000, 残存年数 4.5 年, 固定金利 0.46% 受けの金利スワップを保有しているとする。現在のスワップ金利が教科書図 5.2 で与えられている場合, その価値はいくらとなるか。
- (II) デルタ, ガンマはいくらとなるか。また, 金利が 10bp 上昇した場合, このスワップの価値はいくらとなるか, デルタとガンマを用いて計算せよ。
- (III) もし, 4 年のスワップ金利のみが現在の値から 1bp 上昇した場合, このスワップの価値はいくらとなるか。