

# ファイナンス・セミナー 2024-1

入場無料

## 「金利モデルの理論と実践」

2024年3月25日(月) 19:00~20:30

明治大学駿河台キャンパス アカデミーコモン 9階 309A 教室

### 講演内容

金利モデルは、金融商品の価格付けやリスク管理などにおいて不可欠な役割を果たしている。本セミナーでは、金利をモデル化する目的から出発し、基本的な金利モデルから SPDE（確率偏微分方程式）に関する発展的な研究までを、ビジネスにおける具体的なイメージを使って理解しやすいように解説する。

- ・金利が登場する事例（事業価値の算定、Eコマースのマーケティング戦略や債券の運用戦略の構築、金融商品の評価、リスク管理など）
- ・代表的な金利モデルの紹介
- ・近年の潮流（マイナス金利、金利指標改革、機械学習の影響）
- ・発展的な研究（SPDE による金利モデルの表現やフォワード・カーブの部分多様体の考察から見えてくるもの）
- ・金利モデルの今後の展望



### 講師

株式会社三菱 UFJ 銀行 融資企画部 中山季之

### 講師略歴

2000年に株式会社三菱 UFJ 銀行に入行して現在に至る。金融商品の評価モデルの研究開発、トレーディングやクレジットマネージメントに従事

現在は明治大学グローバル・ビジネス研究科兼任講師と東京工業大学理学院数学系非常勤講師を兼務  
東京大学大学院 数理科学研究科 博士課程修了（数理科学博士）

### 開催方法

- 対面とオンラインを併用するハイブリット形式

### 申込方法

- 以下の URL または研究科ホームページのリンクから事前登録ください。

<https://forms.office.com/r/jHzDUzWufd>

### 研究科ホームページ

- 2023年度 公開講義・レクチャー実施予定一覧

[https://www.meiji.ac.jp/mbs/information/23open\\_lecture.html](https://www.meiji.ac.jp/mbs/information/23open_lecture.html)

- お問い合わせ先：明治大学専門職大学院事務室  
TEL 03(3296)2397 / E-mail [guroken@mics.meiji.ac.jp](mailto:guroken@mics.meiji.ac.jp)