

Currency Swap

通貨スワップ・クーポンスワップの算出シートです。

- ◆ **対象金利** : 円LIBOR, ドルLIBOR, EURIBORに対応。
- ◆ **評価** : 固定金利・変動金利スプレッド・NPV(時価)のどの項目についても算出可能。
- ◆ **テナー調整** : 参照金利のテナーの違いによるリスクを反映。

【通貨スワップシート】

Quick Currency Swap

No.60034 Ver.0.1.4
with QDateFinder Ver.5.2.4

データ更新日時: 2016/07/13 17:03:02
評価時刻: 2016/07/13 17:03:40

種別		通貨スワップ(元本交換:期初&期末)		設定項目	
■ 基本情報		評価日		データ更新 入力クリア	
		2016/07/13			
開始日	2016/07/15	満期日/年数	2021/07/15	5年	
初回利払日		利払日付指定			
営業日規定	Modified Following				
■ 受取サイド		■ 支払サイド			
通貨	JPY (LIBOR)	通貨	USD (LIBOR)		
固定・変動	変動	固定・変動	変動		
元本(円)	1,041,750,000	元本(\$)	10,000,000.00		
キャッシュフロー回数	quarterly / 3M	キャッシュフロー回数	quarterly / 3M		
アモチ開始日		アモチ開始日			
アモチ額(円)		アモチ額(\$)			
経過日数計算	実日数/360	経過日数計算	実日数/360		
スプレッド(bp)		スプレッド(bp)			
<input type="radio"/>		<input checked="" type="radio"/>			
0.00000		87.60580			
算出結果		NPV(円)		0	
CF現在価値合計(円)	45,174,938.46	CF現在価値合計(円)	45,174,938.46		
CF現在価値合計(\$)	433,644.72	CF現在価値合計(\$)	433,644.72		

【設定項目】*必須項目

- **種別*** 通貨スワップ/クーポンスワップ/フラット為替から選択
- **評価日*** 本日または過去日付を入力
- **開始日*** 取引の開始日を入力
- **満期日/年数*** 取引の満期日もしくは年数を入力
- **初回利払日** 取引の初回利払日の調整が必要な場合に入力
- **利払日付指定** 利払日に指定がある場合に入力 (月末指定の場合(は「31」を入力))
- **営業日規定*** 応当日が休日の場合の調整方法を指定
- **スポット為替レート*** 時価評価に使う為替レートを入力
- **元本計算*** 元本換算の有無を選択
入力した為替レートをを用いて元本を換算

<各サイドで設定> 受取/支払は金利が対象となります

- **通貨*** 対象通貨を選択
- **固定・変動*** 金利の固定/変動を選択
- **元本*** 元本を入力
- **キャッシュフロー回数*** 取引の年間利払回数を選択
- **アモチ開始日** アモチが途中から発生する場合に入力
- **アモチ額** 定額で減額する場合に入力
- **経過日数計算*** 利息の日数計算方式を選択

【算出結果】

スプレッド(bp)	<input checked="" type="radio"/>	74.66128	金利(%)	<input type="radio"/>	0.00000
①算出項目にチェック		NPV(円)	<input type="radio"/>	②算出する項目以外に値を入力	
		0			

■ 円3MLIBORフラットとなるドル3MLIBORのスプレッドを算出する場合

受取サイド: JPY(USD), 変動, quarterly/3M 支払サイド: USD(JPY), 変動, quarterly/3M
①ドルサイドのスプレッドにチェック ②円サイドのスプレッドとNPVに0を入力

■ 円6MLIBOR(払い)とドル6MLIBOR(受け)のベーススワップのNPV(時価)を算出する場合

受取サイド: USD, 変動, semi-annual/6M 支払サイド: JPY, 変動, semi-annual/6M
①NPVにチェック ②円サイドのスプレッドとドルサイドのスプレッドに取引条件を入力

■ フラット為替予約レートの確認

種別でフラット為替を選択し、取引条件を設定

スポット為替レート	113.095	17:02
フラット為替レート/ディスカウント	105.921	7.174

※ご契約の内容により、ご利用いただけない機能がございます。

Currency Swap

【キャッシュフローシート】

キャッシュフローを表示します。アモチ額や応当日の調整も行えます。

キャッシュフロー計算

CF合計(円) 38,797,662.50

No.	応当日	曜日	利息期間日数	元本(円)	アモチ額(円)	採用金利(%)	採用金利(手入力)	金利約定日	キャッシュフロー(円)	ディスカウントファクター	キャッシュフロー(現在価値)
0	2015/02/05	木	全	0	1,173,750,000				-1,173,750,000.00	1	-1,173,750,000.00
1	2015/02/20	水	15	1,173,750,000		0.10429	0.10429	2015/02/03	51,004.33	1.00007950	51,008.38
2	2015/05/20	木	89	1,173,750,000		0.10605		2015/02/18	302,742.03	1.00055282	302,912.16
3	2015/08/20	水	92	1,173,750,000		0.11459		2015/05/18			
4	2015/11/20	木	92	1,173,750,000		0.11377		2015/08/18			
5	2016/02/22	金	94	1,173,750,000		0.11277		2015/11/18			
6	2016/05/20	金	88	1,173,750,000		0.10800		2016/02/18			
7	2016/08/20	金	94	1,173,750,000		0.11024		2016/05/18			
8	2016/11/21	月	91	1,173,750,000		0.12023		2016/08/18			
9	2017/02/21	月	92	1,173,750,000		0.12817		2016/11/17			
10	2017/05/22	月	90	1,173,750,000		0.16871		2017/02/17	495,064.06	1.00824796	499,147.33
11	2017/08/21	月	91	1,173,750,000					18.32	1.00953260	515,789.21
12	2017/11/20	月	91	1,173,750,000					1.39	1.01087458	572,695.21
13	2018/02/20	月	92	1,173,750,000					3.18	1.01228259	616,772.43
14	2018/05/21	月	90	1,173,750,000					2.56	1.01349887	788,322.29
15	2018/08/20	月	91	1,173,750,000					3.81	1.01479842	814,450.63
16	2018/11/20	火	92	1,173,750,000					1.14	1.01611550	921,109.86
17	2019/02/20	水	92	1,173,750,000		0.31706		2018/11/16	951,061.87	1.01745272	967,660.49

応当日の調整を行えます。

変動金利の調整を行えます。ファーストリセットレートが決まっている場合などに手入力します。

変則的なアモチの場合は「アモチ額」欄に手入力します。

【金利データシート】

使用する金利年限の設定やレートの個別設定ができます。

金利データ

LIBOR/EURIBOR				JPY LIBOR				USD LIBOR				EURIBOR			
データ日付	2015/02/03	データ日付	2015/02/03	データ日付	2015/02/03	データ日付	2015/02/03	データ日付	2015/02/03	データ日付	2015/02/03	データ日付	2015/02/03	データ日付	2015/02/03
レートの設定	ユーザ定義	シフト幅(bp)	ユーザ定義	シフト幅(bp)	レートの設定	ユーザ定義	シフト幅(bp)	ユーザ定義	シフト幅(bp)	レートの設定	ユーザ定義	シフト幅(bp)	ユーザ定義	シフト幅(bp)	
<input type="checkbox"/> S/N	0.03714	2015/02/03			<input checked="" type="checkbox"/> 1W	0.13600	2015/02/03			<input checked="" type="checkbox"/> 1W	-0.02500	2015/02/03			
<input checked="" type="checkbox"/> 1W	0.04214	2015/02/03			<input checked="" type="checkbox"/> 1M	0.17100	2015/02/03			<input checked="" type="checkbox"/> 2W	-0.02100	2015/02/03			
<input checked="" type="checkbox"/> 1M	0.07571	2015/02/03			<input checked="" type="checkbox"/> 2M	0.20850	2015/02/03			<input checked="" type="checkbox"/> 1M	0.00100	2015/02/03			
<input checked="" type="checkbox"/> 2M	0.09500	2015/02/03			<input checked="" type="checkbox"/> 3M	0.25510	2015/02/03			<input checked="" type="checkbox"/> 2M	0.02400	2015/02/03			
<input checked="" type="checkbox"/> 3M	0.10429	2015/02/03			<input checked="" type="checkbox"/> 6M	0.35880	2015/02/03			<input checked="" type="checkbox"/> 3M	0.05500	2015/02/03			
<input checked="" type="checkbox"/> 6M	0.14214	2015/02/03			<input type="checkbox"/> 12M	0.61815	2015/02/03			<input checked="" type="checkbox"/> 6M	0.13200	2015/02/03			
<input type="checkbox"/> 12M	0.26614	2015/02/03								<input type="checkbox"/> 9M	0.19900	2015/02/03			
										<input checked="" type="checkbox"/> 12M	0.26600	2015/02/03			

【設定シート】

データの発信元に関する設定、応当日の調整に関する設定、表示項目の設定等を行うことができます。

設定

■ 基本情報

受渡日(T+N)	2
開始日自動設定	する

■ 休日調整

応当日	JPY x USD	東京/ロンドン/ニューヨーク
	JPY x EUR	東京/ロンドン/ユーロ
	JPY x JPY	東京/ロンドン

■ 発信元設定

データ更新	スポット為替レート		トウフォレ上田	
IRS (vs 6M LIBOR)	東短ICAP	MID		
IRS (vs 1M LIBOR)	東短ICAP	MID		
LIBOR 1M x 6M Tenor Spread	Tullett	MID		
LIBOR 3M x 6M Tenor Spread	Tullett	MID		
JPY/USD Currency Spread	Tullett	MID		
JPY/EUR Currency Spread	Tullett	MID		
IRS (vs 6M LIBOR)	Tullett	MID		

■ 金利約定日

金利約定日	JPY LIBOR	ロンドン
	USD LIBOR	ロンドン
	EURIBOR	ユーロ

【DF計算シート/テナー調整金利シート】

金利データから算出したディスカウントファクターおよびテナースプレッドを用いて金利テナーを調整したカーブを表示します。

DF計算(JPY)

評価日	2017/02/03	評価日	2017/02/03	評価日	2017/02/03	評価日	2017/02/03
SPOT	2017/02/07	火	0				
5/N	2017/02/08	水	1	-0.00914	-0.00927	1.00000025	-0.00927
1W	2017/02/14	火	7	-0.03877	-0.03908	1.00000521	-0.03908
1M	2017/03/07	火	28	-0.08364	-0.08369	1.00000283	-0.08369
2M	2017/04/07	金	59	-0.09929	-0.09942	1.00001523	-0.09942
3M	2017/05/08	月	90	0.01129	0.01143	0.99997178	0.01143
6M	2017/08/07	月	181	0.02714	0.02752	0.99998356	0.02752
12M	2018/02/07	火	365	0.03350	0.03360	0.99995009	0.03360
18M	2018/08/07	火	546	0.04200	0.04200	0.99994448	0.04200
2Y	2019/02/07	火	730	0.05000	0.05000	0.99990053	0.05000
2.5Y	2019/08/07	火	911	0.05806	0.05855	0.99851396	0.05857

テナー調整金利(JPY)

評価日	2017/02/03	評価日	2017/02/03	評価日	2017/02/03	評価日	2017/02/03
SPOT	2017/02/07	火	0				
5/N	2017/02/08	水	1				
1W	2017/02/14	火	7				
1M	2017/03/07	火	28	28	1.00000283	-0.00384	1.00000283
2M	2017/04/07	金	59	59	1.00000810	-0.00612	1.00001523
3M	2017/05/08	月	90	90	1.00001563	-0.00873	0.99997178
6M	2017/08/07	月	181	181	1.00002633	-0.01284	
12M	2018/02/07	火	365	365	1.00003978	-0.01614	
18M	2018/08/07	火	546	546	1.00005657	-0.01949	
2Y	2019/02/07	火	730	730	1.00007618	-0.02277	
2.5Y	2019/08/07	火	911	911	1.00009447	-0.02620	

※ご契約の内容により、ご利用いただけない機能がございます。