

【公報種別】特許法第17条の2の規定による補正の掲載

【部門区分】第6部門第3区分

【発行日】平成26年11月27日(2014.11.27)

【公表番号】特表2013-536525(P2013-536525A)

【公表日】平成25年9月19日(2013.9.19)

【年通号数】公開・登録公報2013-051

【出願番号】特願2013-525889(P2013-525889)

【国際特許分類】

**G 0 6 Q 40/04 (2012.01)**

【F I】

G 0 6 Q 40/04 1 1 0

【誤訳訂正書】

【提出日】平成26年10月3日(2014.10.3)

【誤訳訂正1】

【訂正対象書類名】明細書

【訂正対象項目名】0 0 5 2

【訂正方法】変更

【訂正の内容】

【0 0 5 2】

図1には、本発明に係るノンバイアス、中央清算型金融商品の最終価値のキャッシュフローの純累積価値を決定するための実施例を示すフローチャートが示してある。金利スワップの場合、本発明のノンバイアス、中央清算型金融商品は、そのクーポンとして固定金利を有し得るものであり、スワップの期間はその終了を規定する。これらの要因を考慮して、キャッシュフローの純累積価値 (net accumulated value of cash flows) は、具体的に以下のように決定される。

キャッシュフローの純累積価値 (net accumulated value of cash flow) =

$$\sum_{i=1}^N C_i B(t_{c,i}, T) - \sum_{i=1}^M L_i B(t_{l,i}, T)$$

ここで、

$C_i$  は、時刻  $t_{c,i}$  において支払い可能な固定金利部分 (fixed leg payment) の支払額；

$L_i$  は、時刻  $t_{l,i}$  において支払い可能な変動金利部分 (floating leg) の支払額；

$T$  は、金融商品の終了；

$B(t, T)$  は、時刻  $t$  に初期預金としてオーバーナイト・レートで累積された時刻  $T$  における金融市场預金口座 (money market account) の価値、である。