

## 通信テキスト正誤表

### 第2次レベル

#### 【証券分析とポートフォリオ・マネジメント】

#### 第3回テキスト

頁	行	誤	正
3	最終行	「ポートフォリオの最終利回り」とは	「ポートフォリオの修正デュレーション」とは

#### 第10回テキスト

頁	行	誤	正
47	12	結果、回収率は・・・	結果、デフォルト時損失率は・・・
71	最終行	$PD' = \dots = \underline{N(-1.0189)} = 0.1568 = 15.68\%$	$PD' = \dots = \underline{N(-1.0073)} = 0.1568 = 15.68\%$

#### 《 お知らせ 》

テキスト6頁に記載されているEXCELプログラムを以下に掲載します。このプログラムを実際に動かしてシミュレーションを行い、信用リスクモデルに対する知識を一層深められることを期待します。

[http://www.saa.or.jp/curriculum/right\\_wrong/2nd/pdf/simulation.exe](http://www.saa.or.jp/curriculum/right_wrong/2nd/pdf/simulation.exe)