

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10回テキスト通信テキスト正誤表

93 頁 6 行目

誤

$$DD^Q = \frac{\log\left(\frac{1}{0.9}\right) + \left(0.03 - \frac{0.2^2}{2}\right)1}{0.2\sqrt{1}} = \frac{0.1054 + 0.01}{0.2} \approx 0.06$$

正

$$DD^Q = \frac{\log\left(\frac{1}{0.9}\right) + \left(0.03 - \frac{0.2^2}{2}\right)1}{0.2\sqrt{1}} = \frac{0.1054 + 0.01}{0.2} = \frac{0.1154}{0.2} = 0.577 \approx 0.58$$

93 頁 9 行目

誤

$$PD^Q(1) = \dots 1 - N(0.06) = 1 - 0.5239 = 0.4761$$

正

$$PD^Q(1) = \dots 1 - N(0.58) = 1 - 0.7190 = 0.2810$$

以上