

森平爽一郎

『信用リスクモデリング』、朝倉書店、正誤表

2010年10月30日現在

| ページ   | 行                                      | 誤り                                                                                                                                                         | 正しい                                                                                                                                                              |
|-------|----------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| P. ii | 下から 5 行目                               | 岡崎貫治 (現 CRD 協会)                                                                                                                                            | 岡崎貫治 (現監査法人トーマツ)                                                                                                                                                 |
| P. ii | 下から 6 行目                               | 渡邊泰之(現あらた監査法人)                                                                                                                                             | 渡辺康之(現監査法人 双研社)                                                                                                                                                  |
| P.9   | 下から 3 行目                               | $RR(1) = 1 - LCD$                                                                                                                                          | $RR(1) = 1 - LGD$                                                                                                                                                |
| P18   | 13 行目<br>式(1.27)                       | $\exp\left(-\left[r(t) + PD^Q(t) LGD(t)\right]\right)$                                                                                                     | $\exp\left(-\left[r(t) + PD(t) LGD(t)\right]\right)$                                                                                                             |
| P31   | 注 2 の 4 行目                             | $w_i^t = N / \sum_{i=1}^T N_i^t$                                                                                                                           | $w_i^t = N_i^t / \sum_{i=1}^T N_i^t$                                                                                                                             |
| P32   | 下から 1 行目、式 (2.9) の最後の式の分子<br><br>第 1 項 | $(1/T) \sum_{i=1}^T D_i^t \cdot D_j^t / N_i^t \cdot N_j^t$                                                                                                 | $(1/T) \sum_{i=1}^T \left[ (D_i^t \cdot D_j^t) / (N_i^t \cdot N_j^t) \right]$                                                                                    |
| p.37  | 式 2-11                                 | $S(t) = \Pr(T_j > t)$<br>$= \prod_{t_j < t} \left( \frac{n_{t_j} - d_{t_j}}{n_{t_j}} \right) = \prod_{t_j < t} \left( 1 - \frac{d_{t_j}}{n_{t_j}} \right)$ | $S(t) = \Pr(T_j > t)$<br>$= \prod_{t_j \leq t} \left( \frac{n_{t_j} - d_{t_j}}{n_{t_j}} \right) = \prod_{t_j \leq t} \left( 1 - \frac{d_{t_j}}{n_{t_j}} \right)$ |
| p.41  | 5 行目                                   |                                                                                                                                                            | <b>(2.16)'</b> 式番号追加                                                                                                                                             |
| p.41  | 6 行目                                   | 式(2.15)                                                                                                                                                    | 式(2.16)                                                                                                                                                          |
| p.41  | 13 行目                                  | 式(1.58)                                                                                                                                                    | 式(2.1)                                                                                                                                                           |
| p.41  | 7 行目                                   | 式(2.15)の左辺を $DF_t$                                                                                                                                         | 式(2.15)'の右辺を $FD_t$                                                                                                                                              |
| p.41  | 8 行目                                   | $\tilde{\varepsilon} = (FD_t - FD_t) \dots$                                                                                                                | $\tilde{\varepsilon} \approx (FD_t - FD_t) \dots$                                                                                                                |
| P41   | 下から 4,5 行目                             | $DF_t$                                                                                                                                                     | $FD_t$                                                                                                                                                           |

|       |             |                                            |                                                  |
|-------|-------------|--------------------------------------------|--------------------------------------------------|
| p.41  | 下から 1<br>行目 | Berkson                                    | 削除                                               |
| p.41  |             | Maddara[1983]の 2.3 節                       | Maddara[1983]の 2.8 節                             |
| P42   | 6 行目        | 式(1.57)                                    | 式(2.14)                                          |
| P42   | 13 行目       | 式 (2.13)                                   | 式(2.14)                                          |
| P42   | 15 行目       | 式(2.15)                                    | 式(2.14)                                          |
| p.81  | 2 行目        | $S_t = \frac{1}{N_t} \sum_{i=1}^{N_t} > 0$ | $S_t = \frac{1}{N_t} \sum_{i=1}^{N_t} \cdot > 0$ |
| P117  | 図           | 将来の負債価値                                    | 負債額面                                             |
| P125  | 5 行目        | 方程式 3 : 株式の期待成長率と資産の期待成長率～                 | 方程式 3: 株式投資収益率のボラティリティと資産成長率のボラティリティ～            |
| P146  | 9 行目        | 第 2 のパラメトリック                               | 第 2 の <b>ノン</b> パラメトリック                          |
| p.200 | 3 行目        | Maddara[1970]                              | Maddara[1983]                                    |