

正誤表

論文名：「コンピュータの金融実務での具体的な活用方法の解説」

筆者：戸坂 凡展・吉羽 要直

掲載号：『金融研究』、第 24 巻別冊第 2 号、115～162 頁、2005 年 12 月

修正日：2009 年 10 月 20 日

- 126 頁 (21)式左辺：

$$\left[\frac{1}{(2\pi)^{N/2} \sqrt{|\Sigma|}} \exp\left(-\frac{1}{2} \mathbf{x}^T \Sigma^{-1} \mathbf{x}\right) \right] \rightarrow \left[\frac{1}{(2\pi)^{n/2} \sqrt{|\Sigma|}} \exp\left(-\frac{1}{2} \mathbf{x}^T \Sigma^{-1} \mathbf{x}\right) \right]$$

- 126 頁 (22)式左辺：

$$\left[C(u_1, \dots, u_n) \right] \rightarrow \left[c(u_1, \dots, u_n) \right]$$

- 126 頁 脚注 15 の分布関数の式：

$$\begin{aligned} & \left[\frac{1}{(2\pi)^{N/2} \sqrt{|\Sigma|}} \int_{-\infty}^{x_n} \dots \int_{-\infty}^{x_1} \exp\left(-\frac{1}{2} (z_1, \dots, z_n) \Sigma^{-1} (z_1, \dots, z_n)^T\right) dz_1 \dots dz_n \right] \\ & \rightarrow \left[\frac{1}{(2\pi)^{n/2} \sqrt{|\Sigma|}} \int_{-\infty}^{x_n} \dots \int_{-\infty}^{x_1} \exp\left(-\frac{1}{2} (z_1, \dots, z_n) \Sigma^{-1} (z_1, \dots, z_n)^T\right) dz_1 \dots dz_n \right] \end{aligned}$$

- 126 頁 (27)式右辺：

$$\left[2 \lim_{x \rightarrow \infty} \Phi_1\left(x \sqrt{\frac{1-\rho}{1+\rho}}\right) \right] \rightarrow \left[2 \lim_{x \rightarrow -\infty} \Phi_1\left(x \sqrt{\frac{1-\rho}{1+\rho}}\right) \right]$$

- 129 頁 (29)式右辺の分子第 3 項の 2 次形式：

$$\left[\boldsymbol{\omega}' \Sigma^{-1} \boldsymbol{\omega} \right] \rightarrow \left[\boldsymbol{\omega}^T \Sigma^{-1} \boldsymbol{\omega} \right]$$

- 132 頁 囲み記事「アルゴリズム (t コピュラのパラメータ推定法)」第 5 手順の漸化式の右辺 :

$$\left[\frac{\nu+n}{N\nu} \sum_{j=1}^N \frac{\boldsymbol{\omega}^j \boldsymbol{\omega}^{jT}}{\nu + \boldsymbol{\omega}^{jT} \hat{\Sigma}(m)^{-1} \boldsymbol{\omega}^j} \right] \rightarrow \left[\frac{\nu+n}{N} \sum_{j=1}^N \frac{\boldsymbol{\omega}^j \boldsymbol{\omega}^{jT}}{\nu + \boldsymbol{\omega}^{jT} \hat{\Sigma}(m)^{-1} \boldsymbol{\omega}^j} \right]$$

- 137 頁 囲み記事「アルゴリズム (クレイトン・コピュラに従う乱数発生法)」の第 3 手順 :

$$\left[U_i \leftarrow \{1 - (1/\theta_0) \ln I_i\}^{-1/\theta_0} \text{ として} \right] \rightarrow \left[U_i \leftarrow \{1 - (1/\theta_0) \ln I_i\}^{-1/\alpha} \text{ として} \right]$$

- 153 頁 脚注 42 の 2 行目 :

「プラグラム」 → 「プログラム」

- 158 頁 (A-19)式の直前の行 :

「ドバイ (Dybye) 関数」 → 「デバイ (Debye) 関数」

- 160 頁 脚注 44 :

「本論(11)式のケンドールのタウ」 → 「本論(12)式のケンドールのタウ」

- 160 頁 脚注 44 ケンドールのタウの推定値 $\hat{\tau}$:

$$\left[\hat{\tau} = \frac{P-Q}{P+Q} = \frac{2(P-Q)}{N(N+1)} \right] \rightarrow \left[\hat{\tau} = \frac{P-Q}{P+Q} = \frac{2(P-Q)}{N(N-1)} \right]$$

修正日 : 2010 年 5 月 20 日

- 160 頁 脚注 44 :

「 $(x_1^i - x_2^i)(x_1^j - x_2^j) > 0 (< 0)$ となる」 → 「 $(x_1^i - x_1^j)(x_2^i - x_2^j) > 0 (< 0)$ となる」

以上