

平成19年12月20日現在

『フィナンシャルエンジニアリング【第5版】』正誤表

ページ	誤	正
32P 4 行目	現資産	原資産
91P 14 行目	1782.53 <u>米</u> ドルを売却 (1782.53 × 0.66 = 1176.47 <u>豪</u> ドルを購入)	1782.53 <u>豪</u> ドルを売却 (1782.53 × 0.66 = 1176.47 <u>米</u> ドルを購入)
94P 24 行目	ここで、 <u>は</u>	ここでは、 <u>は</u>
97P 5 行目	$F_0 e^{yT} = S_0 e^{(r+u-y)T}$	$F_0 = S_0 e^{(r+u-y)T}$
107P 13 行目	$F_1 \leq F_2 e^{y(t_2-t_1)}$	$F_1 \leq F_2 e^{r(t_2-t_1)}$
115P	原油精鍊	原油精製
132P 5 行目	先物 1 契約の原資産株式の現在価値	先物 1 契約の原資産となる株式の現在価値
147P 18 行目	$\frac{\partial v}{\partial h} = 2h\rho\sigma_F^2 - 2h\rho\sigma_S\sigma_F$	$\frac{\partial v}{\partial h} = 2h\sigma_F^2 - 2\rho\sigma_S\sigma_F$
325P 18 行目	$22q + 18(1-q) = 20e^{0.6*3/12}$	$22q + 18(1-q) = 20e^{0.16*3/12}$
344P6 行目	同様に分散は	同様に標準偏差は
345P18 行目	また、(10.2) 式から	また、(11.2) 式から
356P 163 行目	株式の先物契約について	株式のフォワード契約について
356P ~ 357P	$e^{r\cdots}$ (8 箇所)	$e^{r\cdots}$
357P 16 行目	$\frac{\partial G}{\partial S} = \frac{1}{S}, \quad \frac{\partial^2 G}{\partial S^2} = -\frac{1}{S^2}$	$\frac{\partial G}{\partial S} = \frac{1}{S}, \quad \frac{\partial^2 G}{\partial S^2} = -\frac{1}{S^2}$
370P3 行目	$\text{var}(S_T) = S_0^2 e^{2\mu T} (e^{\sigma^2 T} - 1)$	$\text{var}(S_T) = S_0^2 e^{2\mu T} (e^{\sigma^2 T} - 1)$
384P 6 行目	1. <u>デリバティブ</u> の期待値は、	1. <u>原資産</u> から得られる期待収益率は、
386P 14 行目	<u>ヨーピアン</u>	<u>ヨーロピアン</u>
467P10 行目	: 株式	: 先物契約
481P 19 行目	14.1 節 <u>よる</u> 0.522	14.1 節 <u>より</u> 0.522
546P	www.rotman.utoront.ca (2 箇所)	www.rotman.utoronto.ca
806P 8 行目	変動利付債であると最初に	変動利付債を最初に
894P1 行目	第 23 章	第 22 章
894P2 行目	第 22 章	第 23 章