

予稿集：お詫びと訂正

誤

2. 目標の規制基準の $CAR=0.08$ との比 R を以下のように定義し，計算する．

$$R = \frac{CAR(\mathbf{x})}{0.08} \quad (9)$$

3. 現在のポートフォリオ構成 \mathbf{x} の期待価格での時価総額を計算する．以下， $Val(\mathbf{x})$ とする．
4. 次式に基づき，再度ポートフォリオを構成する時の予算制約 B を以下のように定義し，計算する．

$$B = \frac{1}{\frac{R-1}{2} + 1} \cdot Val(\mathbf{x}) \quad (10)$$

5. 予算制約 B のもとで，規制なしポートフォリオエージェント同様にポートフォリオを最適化し， \mathbf{x} を更新する．
6. この新しい \mathbf{x} が $CAR(\mathbf{x}) \leq 0.08$ を満たしているかチェックする

正

2. 目標の規制基準の $CAR=0.08$ との比 R を以下のように定義し，計算する．

$$R = \frac{0.08}{CAR(\mathbf{x})} \quad (9)$$

3. 現在のポートフォリオ構成 \mathbf{x} の期待価格での時価総額を計算する．以下， $Val(\mathbf{x})$ とする．
4. 次式に基づき，再度ポートフォリオを構成する時の予算制約 B を以下のように定義し，計算する．

$$B = \frac{1}{\frac{R-1}{2} + 1} \cdot Val(\mathbf{x}) \quad (10)$$

5. 予算制約 B のもとで，規制なしポートフォリオエージェント同様にポートフォリオを最適化し， \mathbf{x} を更新する．
6. この新しい \mathbf{x} が $CAR(\mathbf{x}) \geq 0.08$ を満たしているかチェックする