

42 頁

(誤)	<p>注意：これは、次のように考えてみる。Y 球団と G 球団があり証券 α は Y 球団が優勝すると 2 もらう、G 球団が優勝すると 1 払う。証券 β は G 球団が優勝すると 1 払い、Y 球団が優勝すると 2 もらうという証券であると考えればどうだろうか。</p>
-----	--

(正)	<p>注意：これは、次のように考えてみる。Y 球団と G 球団があり証券 α は Y 球団が優勝すると 2 もらう、G 球団が優勝すると 1 払う。証券 β は Y 球団が優勝すると 1 払い、G 球団が優勝すると 2 もらうという証券であると考えればどうだろうか。</p>
-----	--

152 頁

(誤)	$\frac{\partial C}{\partial S} = \Phi \left(\frac{\log \frac{S}{K} + \left(r - \frac{1}{2} \sigma^2 \right) T}{\sigma \sqrt{T}} \right) > 0$
-----	--

(正)	$\frac{\partial C}{\partial S} = \Phi \left(\frac{\log \frac{S}{K} + \left(r + \frac{1}{2} \sigma^2 \right) T}{\sigma \sqrt{T}} \right) > 0$
-----	--

155 頁

(誤)	$\begin{aligned} \bar{C}(t, S) &= e^{-r(T-t)} E[f(\text{Se}^{(r-\frac{1}{2}\sigma^2)(T-t)+\sigma W_{T-t}})] \\ &= e^{-r(T-t)} \int_{-\infty}^{+\infty} f(\text{Se}^{(r-\frac{1}{2}\sigma^2)(T-t)+\sigma\sqrt{T-t}x}) \frac{1}{\sqrt{2\pi}} e^{-\frac{1}{2}x^2} dx \end{aligned}$
-----	--

(正)	$\begin{aligned} \bar{C}(t, S) &= e^{-r(T-t)} E[f(\text{Se}^{(r-\frac{1}{2}\sigma^2)(T-t)+\sigma W_{T-t}})] \\ &= e^{-r(T-t)} \int_{-\infty}^{+\infty} f(\text{Se}^{(r-\frac{1}{2}\sigma^2)(T-t)+\sigma\sqrt{T-t}x}) \frac{1}{\sqrt{2\pi}} e^{-\frac{1}{2}x^2} dx \end{aligned}$
-----	--