

『新版 ファイナンスの確率解析入門』 第1刷正誤表

表記書籍の第1刷（2017年3月7日発行）に以下の誤りがありました。
訂正してお詫び申し上げます。

ページ数	位置	誤 (黄色マーカー部)	正
22	1行目	するとコールオプション 1 単位	するとデリバティブ 1 単位
22	[注意]	Black-Sholes partial differential equation	Black-Scholes partial differential equation
25	2行目	Z_t と Z'_t の基本的な性質 ……	Z_t と Z'_t の基本的な性質 ……
25	例題 3.1 の 1行目	…… 以下の (1)～(11) を求めよ.	…… 以下の (1)～(8) を求めよ.
30	図 3.2 内	$E(Z X)$	$E(W X)$
31	下から 7行目	…… $+ 2x E(Z_5 - Z_3) + \dots$	…… $+ 2(x_1 + x_2 + x_3) E(Z_5 - Z_3) + \dots$
31	下から 3行目	$= E(\dots + Z_s^2 + t \xi_s, \dots, \xi_1)$	$= E(\dots + Z_s^2 - t \xi_s, \dots, \xi_1)$
34	5～6行目	…… に関するマルチンゲール, したがってマルチンゲールである.	…… に関するマルチンゲールである.
40	例題 3.6 の 1行目	α を定数とする $U_t = \dots$	α を定数とする. $U_t = \dots$
49	5行目	…… M_T の分布が ……	…… M_T (M_T を $\max_{0 \leq s \leq T} Z_s$ とする) の分布が ……
53	12行目	まず, マルチンゲール表現定理 (定理 3.5) を用いると, ……	まず, マルチンゲール表現定理 (定理 3.6) を用いると, ……
55	4～5行目	…… ある時点とほかのある時点の ……	…… ある時点とほかのある時点の ……
55	下から 2行目	…… $t = 0$ から $t = T$ まで ……	…… $t = 0$ から $t = T - 1$ まで ……
56	下から 13行目	…… 初期資金 $C = E^Q(e^{-rT}Y) = M_0$ を ……	…… 初期資金 $C = E^Q((1+r)^{-T}Y) = M_0$ を ……
59	11～16行目 (6ヵ所)	$\lim_{\Delta \rightarrow 0}$	$\lim_{\Delta t \rightarrow 0}$
124	下から 3行目	ノックインオプションの価格	ノックインコールオプションのペイオフ
124	下から 2行目	ノックアウトオプションの価格	ノックアウトコールオプションのペイオフ
125	7.3.4 項内の 11行目	コンパウンドオプションの価格	コンパウンドオプションのペイオフ

125	下から 3 行目	フィックスドストライクルックバックオプション の価格 ^は	フィックスドストライクルックバックオプション のペイオフ ^は
125	下から 2 行目	フローティングストライクルックバックオプション の価格 ^は	フローティングストライクルックバックオプション のペイオフ ^は
127	下から 11～10 行目	「インシュラス (Insurance)」	「インシュランス (Insurance)」
144	下から 13 行目	ある可算個の点 $x_1, x_2, \dots, x_n$ が存在して,	ある可算個の点 $x_1, x_2, \dots, x_n, \dots$ が存在して,
144	下から 11 行目	$\sum_{i=1}^n p_i$	$\sum_{i=1}^{\infty} p_i$
145	5～6 行目	……… X の確率分布 (probability distribu- tion) という.	……… X の確率分布 (probability distribu- tion) という.
146	13 行目	$E(g(X)) = \begin{cases} \sum g(x)P(X=x) \\ \int_{-\infty}^{+\infty} g(x)f_X(x)dx \end{cases}$	$E(g(X)) = \begin{cases} \sum g(x)P(X=x) \\ \int_{-\infty}^{+\infty} g(x)f_X(x)dx \end{cases}$
155	下から 3 行目	ポアソンの小数の法則	ポアソンの少数の法則
157	4 行目	$\lim_{\Delta t \rightarrow \infty} P(\text{Ge}(\lambda \Delta t) \leq t)$	$\lim_{\Delta t \rightarrow \infty} P\left(\text{Ge}(\lambda \Delta t) \leq \frac{t}{\Delta t}\right)$
176	2 行目	$-\left(\frac{2r - \sigma^2}{2r}\right) Se^{rT} \Phi\left(\frac{r\frac{1}{2}\sigma^2}{\sigma} \sqrt{T}\right)$	$-\left(\frac{2r - \sigma^2}{2r}\right) Se^{rT} \Phi\left(\frac{r + \frac{1}{2}\sigma^2}{\sigma} \sqrt{T}\right)$
182	参考文献 [37]	長井英夫 (1999)	長井英生 (1999)
185	索引	ポアソンの小数の法則	ポアソンの少数の法則