

p 34

式 (23)

$$\text{(誤)} \quad C(0) = e^{-rT} E^{Q_B} \left[\left(S(0) e^{\left(r - \frac{1}{2}\sigma^2\right)T + \sigma W^{Q_B}(T)} - K, 0 \right)^+ \right]$$

$$\text{(正)} \quad C(0) = e^{-rT} E^{Q_B} \left[\left(S(0) e^{\left(r - \frac{1}{2}\sigma^2\right)T + \sigma W^{Q_B}(T)} - K \right)^+ \right]$$

これに続く 2 つの式に関しても同様の変更が必要

p 46

一番下の行から 5 行目から 6 行目にかけて

(誤)・・・完全に一致しており、

(正)・・・完全に一致しており、

p 72

一番最後の式

$$\text{(誤)} \quad \frac{S_0}{B_0} = E^Q \left[\frac{C_1(\omega)}{B_1} \right]$$

$$\text{(正)} \quad \frac{S_0}{B_0} = E^Q \left[\frac{S_1(\omega)}{B_1} \right]$$

p 73 の最初の式、および p 75 の最初の式も同様 (合計 3 カ所)

p 72

6 行目

$$\text{(誤)} \quad B_1 = 1 - r$$

$$\text{(正)} \quad B_1 = 1 + r$$

p 85

ページの中頃

$$\text{(誤)} \quad N \left(\begin{pmatrix} \mu_X \\ \mu_Y \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} \delta_X^2 & \rho \delta_X \delta_Y \\ \rho \delta_X \delta_Y & \delta_Y^2 \end{pmatrix} \right)$$

$$\text{(正)} \quad N \left(\begin{pmatrix} \mu_X \\ \mu_Y \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} \sigma_X^2 & \rho \sigma_X \sigma_Y \\ \rho \sigma_X \sigma_Y & \sigma_Y^2 \end{pmatrix} \right)$$

小文字のデルタではなく小文字のシグマ

p 86

2 つ目の式

$$\text{(誤)} \quad = \delta_X^2 + \delta_Y^2 + 2\rho \delta_X \delta_Y$$

$$\text{(正)} \quad = \sigma_X^2 + \sigma_Y^2 + 2\rho \sigma_X \sigma_Y$$

小文字のデルタではなく小文字のシグマ

p 183

上から 8 行目

$$\text{(誤)} \quad V^{FxFwd(0,T)}$$

$$(正) V^{FxFwd}(0, T)$$

p 228

最後の式

$$(誤) = rdt + dW^{Q_B}(t)$$

$$(正) = rdt + \sigma dW^{Q_B}(t)$$