

## 『マルチンゲール理論による統計解析』正誤表 (初版第2刷)

西山陽一

- 13 頁 12 行目: 「これはの」を「これは」に.
- 19 頁 16 行目:  $\nu(G)$  を  $\mu(G)$  に.
- 40 頁 下から 1 行目:  $\frac{1}{Y}$  を  $\frac{1}{Y_s}$  に.
- 56 頁 8 行目: process を processes に.
- 60 頁 下から 9 行目:  $t \mapsto X_t$  がボレル可測であることは仮定する.
- 65 頁 13 行目:  $\rightarrow 0$  を  $= 0$  に.
- 82 頁 5 行目: 「こいうった」を「こういった」に.
- 82 頁 16 行目: ひとつめの  $ds$  を除く. すなわち, 正しくは  $\int_0^T \{|S(X_s)| + |\sigma(X_s)|^2\} ds < \infty$  a.s.
- 95 頁 10 行目:  $dM_s^n$  を  $(dN_s^n - \lambda_s^n ds)$  に.
- 102 頁 下から 8 行目: 「ほとんど全ての」を「ほとんど全ての」に.
- 103 頁 下から 3 行目: 「個数」を「最小個数」に.
- 111 頁 3 行目: 仮定「 $t_n^n \rightarrow \infty$ 」を追加.
- 122 頁 3 行目: 「 $i =$ 」を「 $i, j =$ 」に.
- 124 頁 下から 8 行目:  $V(\theta)$  を  $V^{ij}(\theta)$  に.
- 129 頁 5 行目: ディスプレイされた式を

$$\sup_{t \in [0, T]} \left| \frac{1}{n} \sum_{k=1}^n \int_0^t H_s^n (dN_s^k - Y_s^k e^{\theta_0^\top Z_s^k} \alpha(s) ds) \right| = o_P(1)$$

に変更.

- 137 頁 2, 5, 6 行目:  $g(X_{t_k^n})$  を  $g(X_{t_{k-1}^n})$  に.
- 137 頁 5 行目:  $dt$  を  $ds$  に.
- 139 頁 11 行目:  $V_n^{ij}(\tilde{\theta}_n)$  を  $V_n(\tilde{\theta}_n)$  に.
- 141 頁 4 行目: 「あるとき」を「であるとき」に.
- 143 頁 下から 4 行目: 条件 (iii) を  $\inf_{\theta \in \Theta} \inf_{x \in \mathbb{R}} \sigma(x; \theta) > 0$  に.
- 160 頁 18 行目:  $\xi_k^n, \mathcal{F}_{k-1}^n$  をそれぞれ  $\xi_j^n, \mathcal{F}_{j-1}^n$  に.
- 161 頁 下から 7 行目と 6 行目:  $-2$  を  $+2$  に.
- 163 頁 12 行目の  $iz(N_t - N_s)$  を  $\exp(iz(N_t - N_s))$  に.
- 4 章および 9 章に対する補足:  $\theta_0$  は未知パラメータ  $\theta \in \Theta \subset \mathbb{R}^p$  の真値を表す.
- 9.6 ~ 9.8 節に対する補足: 確率や期待値は, パラメータの真値  $\theta_0$  に依存するので  $P_{\theta_0}, E_{\theta_0}$  と書くべきであるが, これを強調しなくても誤解の恐れがないところでは, 単に  $P, E$  と記している.
- 全体に対する補足: 確率空間  $(\Omega, \mathcal{F}, P)$  上で定義された確率変数  $X, Y$  が, “ $X = Y$  a.s.” であるとは, ある  $A \in \mathcal{F}$  が存在して  $X(\omega) = Y(\omega), \forall \omega \in A$  かつ  $P(A^c) = 0$  であるときにいう. (3.1 節を参照されたい.) “ $X \leq Y$  a.s.” や “確率過程  $t \mapsto X_t$  は a.s. に連続” といった表現も, 同様に定義される. しかしながら, 本書において, 例えば単に “ $X = Y$ ” と書いていても, 実際には “ $X = Y$  a.s.” であることを意味する箇所もあるので, 細部にこだわる方は, 頭の体操と思って逐一確かめつつ読んで頂きたい. (この分野の専門書においては, このような約束に基づく書き方は, 誤解の恐れのない箇所ではしばしばなされる.)