p.312. 【仮定 12.3】 l.3.

誤

$$\int_0^T \sum_{i=1}^2 \pi_i(t)^2\sigma_i(t)^2\mathrm{d}t + \int_0^T \left|\sum_{i=1}^2 \pi_1(t)\left(b_i(t)-r\right)\right|\mathrm{d}t < \infty \quad \text{a.s.}$$

正

$$\int_0^T \sum_{i=1}^2 \pi_i(t)^2\sigma_i(t)^2\mathrm{d}t + \int_0^T \left|\sum_{i=1}^2 \pi_i(t)\left(b_i(t)-r\right)\right|\mathrm{d}t < \infty \quad \text{a.s.}$$

p.314. 【定理 12.1–デリバティブ基本方程式】証明 l.1.

誤　ある集合 $E \in [0,T]\times\Omega$ において，ℓ をルベーグ測度とする直積測度

正　ある集合 $E \subseteq [0,T]\times\Omega$ において，ℓ をルベーグ測度とする直積測度

p.314. 【定理 12.1–デリバティブ基本方程式】証明 l.8.

誤

$$M^{\pi}(T,\omega) = \begin{cases} k\int_0^T S_0(s)^{-1}\left|b_1 - r - \frac{\sigma_1}{\sigma_2(t)}(b_2(t)-r)\right|\mathrm{d}s > 0 & \Longleftarrow \quad \omega \in E', \\ 0 & \Longleftarrow \quad \omega \in E'^c, \end{cases}$$

正

$$M^{\pi}(T,\omega) = \begin{cases} k\int_0^T S_0(s)^{-1}\left|b_1 - r - \frac{\sigma_1}{\sigma_2(s)}(b_2(s)-r)\right|\mathrm{d}s > 0 & \Longleftarrow \quad \omega \in E', \\ 0 & \Longleftarrow \quad \omega \in E'^c, \end{cases}$$

p.315. 【系 12.1】証明 l.2.

誤

$$S_0(t)^{-1}S_2(t) = S_2(0) + \int_0^t S_0(s)^{-1}S_2(s)\left[(b_2(s)-r)\mathrm{d}s + \sigma_2(s)\mathrm{d}B(t)\right].$$

正

$$S_0(t)^{-1}S_2(t) = S_2(0) + \int_0^t S_0(s)^{-1}S_2(s)\left[(b_2(s)-r)\mathrm{d}s + \sigma_2(s)\mathrm{d}B(s)\right].$$

p.319. 【系 12.3 – Black-Scholes 式】証明 下 l.1.

誤

$$= p_1\Phi(\delta) - \mathrm{e}^{-rT}\Phi(\delta - \sigma_1\sqrt{T}).$$

正

$$= p_1\Phi(\delta) - \mathrm{e}^{-rT}K\Phi(\delta - \sigma_1\sqrt{T}).$$

□

p.321. l.5.

誤

$$M^{\overline{\boldsymbol{\pi}}}(t) = \int_0^t S_0(t)^{-1} \sum_{i=1}^{2} \overline{\pi}_i(s)\sigma_i(s)\mathrm{d}B^{(0)}(s), \quad t \in [0,T].$$

正

$$M^{\overline{\boldsymbol{\pi}}}(t) = \int_0^t S_0(s)^{-1} \sum_{i=1}^{2} \overline{\pi}_i(s)\sigma_i(s)\mathrm{d}B^{(0)}(s), \quad t \in [0,T].$$

p.322. 下 l.8.

誤

$$\mathbb{E}[S_0(\tau^*)^{-1}Y(\tau^*)] = \sup_{\tau \in \mathbb{S}} \mathbb{E}^0[S_0(\tau)^{-1}Y(\tau)]$$

正

$$\mathbb{E}^0[S_0(\tau^*)^{-1}Y(\tau^*)] = \sup_{\tau \in \mathbb{S}} \mathbb{E}^0[S_0(\tau)^{-1}Y(\tau)]$$

p.322. 下 l.3.

誤　あるから，$\mathbb{E}[\xi(\tau)] \le \mathbb{E}^0\left[\sup_{t\in[0,T]} S_0(t)^{-1}Y(t)\right]$. 式 (12.22) 及び補題 6.1 よ

正　あるから，$\mathbb{E}^0[\xi(\tau)] \le \mathbb{E}^0\left[\sup_{t\in[0,T]} S_0(t)^{-1}Y(t)\right]$. 式 (12.22) 及び補題 6.1 よ

p.324. **【定理 12.4】証明**l.5.

誤　$\hat{S}_2(t_{n,n}) = Y(T)$ である．ここで，ある一時点 $t_{n,j+1}$，$j = 0, 1, 2, \cdots, T-1$

正　$\hat{S}_2(t_{n,n}) = Y(T)$ である．ここで，ある一時点 $t_{n,j+1}$，$j = 0, 1, 2, \cdots, n-1$

p.326. l.3.

誤　なる．

正　なる．　$\square$