

p.194. 【定理 8.1】 1.2.

誤

$$dX(t) = \beta(t)X(t)dt + \delta(t)X(t)dB(t)$$

正

$$dX(t) = \beta(t)X(t)dt + \delta(t)X(t)dB(t), \quad X(t) > 0$$

p.195. 【問 8.1】 1.2.

誤

$$dX(t) = rX(t)dt + \sigma X(t)dB(t)$$

正

$$dX(t) = rX(t)dt + \sigma X(t)dB(t), \quad X(t) > 0$$

p.197. 1.5.

誤

$$\int_0^T \mathbb{E}[X(t)^2]dt \leq \infty$$

正

$$\int_0^T \mathbb{E}[X(t)^2]dt < \infty$$

p.200. 下 1.5.

誤

$$\leq K_1^2 T t \sup_{t \in [0, t]} \left\{ \left| \xi_s^{(n)} - \xi_s \right|^2 \right\}.$$

正

$$\leq K_1^2 T t \sup_{s \in [0, t]} \left\{ \left| \xi_s^{(n)} - \xi_s \right|^2 \right\}.$$

p.200. 式 (8.21) 最右辺.

誤

$$\leq K_1^2 T t \sup_{t \in [0, t]} \left\{ \left| \xi_s^{(n)} - \xi_s \right|^2 \right\}.$$

正

$$\leq K_1^2 T t \sup_{s \in [0, t]} \left| \xi_s^{(n)} - \xi_s \right|^2.$$

2

p.201. 1.1.

誤

$$\leq \frac{\delta}{\epsilon^2} + P \left\{ K_1^2 t \sup_{t \in [0, t]} \left\{ \left| \xi_t^{(n)} - \xi_t \right|^2 \right\} > \delta \right\}.$$

正

$$\leq \frac{\delta}{\epsilon^2} + P \left\{ K_1^2 t \sup_{s \in [0, t]} \left| \xi_s^{(n)} - \xi_s \right|^2 > \delta \right\}.$$

p.201. 1.3.

誤

$$P \left\{ \sup_{t \in [0, 1]} \left\{ \left| \xi_t^{(n)} - \xi_t \right|^2 \right\} > \delta \right\} \rightarrow 0 \quad (n \rightarrow \infty)$$

正

$$P \left\{ \sup_{s \in [0, t]} \left| \xi_s^{(n)} - \xi_s \right|^2 > \delta \right\} \rightarrow 0 \quad (n \rightarrow \infty)$$

p.201. 1.7.

誤 最後に, $\int_0^T \mathbb{E} \left[(\xi_t)^2 \right] dt \leq \infty$ が成立することを示す. (8.12) より,

正 最後に, $\int_0^T \mathbb{E} \left[(\xi_t)^2 \right] dt < \infty$ が成立することを示す. (8.12) より,

p.201. 【強解の Markov 性】 1.1.

誤 μ と σ は, $\mathbb{R} \times \mathbb{R}^+$ 上の Borel 可測関

正 μ と σ は, $\mathbb{R} \times [0, T]$ 上の Borel 可測関

p.202. 1.1.

誤 た, η を $\sigma(B(t); t \in \mathbb{R}^+)$ から独立で $\mathbb{E}[\eta^2] < \infty$ となる確率変数として, \mathcal{F}_t を

正 た, η を $\sigma(B(t); t \in [0, T])$ から独立で $\mathbb{E}[\eta^2] < \infty$ となる確率変数として, \mathcal{F}_t を

p.204. 【補題 8.3】 1.3.

誤

$$\xi_{x,s}(t) := x + \int_s^t \mu(\xi(u)_{x,s}, u) du + \int_s^t \sigma(\xi(u)_{x,s}, u) dB(u)$$

正

$$\xi_{x,s}(t) := x + \int_s^t \mu(\xi_{x,s}(u), u) du + \int_s^t \sigma(\xi_{x,s}(u), u) dB(u)$$

p.204. 式 (8.26) 左辺.

誤

$$E \left[\sup_{t \in [s_2, T]} |\xi_{x_1, s_1}(t) - \xi_{x_2, s_2}(t)|^2 \right]$$

正

$$\mathbb{E} \left[\sup_{t \in [s_2, T]} |\xi_{x_1, s_1}(t) - \xi_{x_2, s_2}(t)|^2 \right]$$

p.206. 【補題 8.4】 1.6.

誤

$$\epsilon > 0, t \in \mathbb{R}^+, x \in \mathbb{R}$$

正

$$t \in \mathbb{R}^+, x \in \mathbb{R}.$$