

正誤表

1 ページ 18 行目

(誤) 内田 義彦

(正) 内田 善彦

5 ページ 12 行目

(誤) $Ma[S(T) - K, 0] = S(T) - K + Ma[K - S(T), 0]$

(正) $Max[S(T) - K, 0] = S(T) - K + Max[K - S(T), 0]$

19 ページ 1 行目

(誤) $C(t) = D(T-t) \cdot E^Q [Ma(\tilde{S}(T) - K, 0)], \quad D(s) = e^{-rs}$

(正) $C(t) = D(T-t) \cdot E^Q [Max(\tilde{S}(T) - K, 0)], \quad D(s) = e^{-rs}$

23 ページ 24 行目

(誤) $\bar{V}_i(C, F) = V_i + E_i [\gamma(t, T \wedge \tau; C) + \varphi(t, T \wedge \tau; F + 1_{\{t < \tau < T\}} D(t, \tau) \cdot \theta_\tau(C, \varepsilon))]$

(正) $\bar{V}_i(C, F) = E_i [\pi(t, T \wedge \tau) + \gamma(t, T \wedge \tau; C) + \varphi(t, T \wedge Y; F) + 1_{\{t < \tau < T\}} D(t, \tau) \cdot \theta_\tau(C, \varepsilon)]$

23 ページ 27 行目

(誤) $\lambda(t, T; C)$: 担保マージンコストの現在価値

(正) $\gamma(t, T; C)$: 担保マージンコストの現在価値

26 ページ 23 行目

(誤) $\Delta N I \neq GAP \cdot \Delta r$

(正) $\Delta N I = GAP \cdot \Delta r$