

「基礎からわかる LIBOR マーケット・モデルの実務」正誤表 2014/12/8

該当箇所	誤	正
9 ページ下から 6 行目	$P_{flt}(0) - P_{fix}(0) = Not \sum_{n=0}^N \delta_n L_n(0) Df(0, T_{n+1})$ $- Not K \sum_{n=0}^N K \delta_n Df(0, T_{n+1})$	$P_{flt}(0) - P_{fix}(0) = Not \sum_{n=0}^N \delta_n L_n(0) Df(0, T_{n+1})$ $- Not \sum_{n=0}^N K \delta_n Df(0, T_{n+1})$
4 1 ページ 1 行目	$\Phi_N(x) = \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \exp - \frac{x^2}{2t}$	$\Phi_N(x) = \frac{1}{\sqrt{2\pi t}} \exp - \frac{x^2}{2t}$
5 0 ページ下から 3 行目	$dW_n(t) dW_m(t) = \rho_{nm}(t)$	$dW_n(t) dW_m(t) = \rho_{nm}(t) dt$
5 4 ページ 3 行目	<b>Lornormal</b>	<b>Lognormal</b>
5 4 ページ 4 行目	$\mu_n(t) = \sum_{j=n+1}^N \frac{\delta_j L_j(t) \sigma_n(t) \sigma_j(t) \rho_{nj}(t)}{(1 + \delta_j L_j(t))}$	$\mu_n(t) = - \sum_{j=n+1}^N \frac{\delta_j L_j(t) \sigma_n(t) \sigma_j(t) \rho_{nj}(t)}{(1 + \delta_j L_j(t))}$
5 5 行目下から 6 行目	$\frac{dD_{n+1}(t)}{D_{n+1}(t)} = \sum_{j=\eta(t)}^n \frac{\delta_j L_j(t)}{1 + \delta_j L_j(t)} \delta_j(t) dW_j(t)$	$\frac{dD_{n+1}(t)}{D_{n+1}(t)} = - \sum_{j=\eta(t)}^n \frac{\delta_j L_j(t)}{1 + \delta_j L_j(t)} \sigma_j(t) dW_j(t)$
5 6 ページ下から 6 行目	$\mu_n(t) = \sum_{j=n+1}^N \frac{\delta_j (L_j(t) + b_j) \sigma_n(t) \sigma_j(t) \rho_{nj}(t)}{(1 + \delta_j L_j(t))}$	$\mu_n(t) = \sum_{j=n+1}^N \frac{\delta_j (L_j(t) + a_j) \sigma_n(t) \sigma_j(t) \rho_{nj}(t)}{(1 + \delta_j L_j(t))}$
6 2 ページ下から 6 行目	$\frac{PS(0)}{A_{nm}(0)}$ $= E^{nm} \left[ \frac{\sum_{j=n-1}^{m-1} Df(T_{reset}, T_{j+1}) (L_j(T_{reset}) - K)^+}{A_{nm}(T_{reset})} \right]$	$\frac{PS(0)}{A_{nm}(0)}$ $= E^{nm} \left[ \frac{\{\sum_{j=n-1}^{m-1} Df(T_{reset}, T_{j+1}) (L_j(T_{reset}) - K)\}^+}{A_{nm}(T_{reset})} \right]$
6 5 ページ 1 2 行目	$L_n(t_{j+1}) = L_n(t_j) \exp \left( \left( -\frac{1}{2} \sigma_n^2(t_j) + \mu_n(\{L(t_j)\}) \right) dt + \sqrt{dt} \sigma_n(t_j) x_n \right)$	$L_n(t_{j+1}) = L_n(t_j) \exp \left( \left( -\frac{1}{2} \sigma_n^2(t_j) dt + \mu_n(\{L(t_j)\}) \right) dt + \sqrt{dt} \sigma_n(t_j) x_n \right)$
6 6 ページ 6 行目	$D_n(t_{j+1}) = \exp \left( -\frac{1}{2} \Lambda^2(t_j) dt + \sqrt{t} \sum_{j=n}^N \lambda_j(t_j) x_j \right)$	$D_n(t_{j+1}) = \exp \left( -\frac{1}{2} \Lambda^2(t_j) dt + \sqrt{t} \sum_{k=n}^N \lambda_k(t_j) x_k \right)$
6 9 ページ 図表 1 4	<b>Va 1</b>	<b>Val</b>
6 9 ページ 図表 1 4	<b>Va</b>	<b>Val</b>
9 8 ページ 7 行目	$x(z) = \log \left\{ \frac{\sqrt{1 - 25\rho + z^2} + z - 5}{1 - 5} \right\}$	$\chi(z) = \log \left\{ \frac{\sqrt{1 - 2\rho z + z^2} + z - \rho}{1 - \rho} \right\}$

以上