

本書につき記載に誤りがありました。お詫びのうえ下記のとおり訂正申し上げます。

□P144 (式7-1)を下記に差し替えます。

$$\begin{aligned} V(t_k) &= \delta_{\eta(t_k)-1} L_{\eta(t_k)-1}(T_{\eta(t_k)-1}) D(t_k, T_{\eta(t_k)}) \\ &+ \sum_{j=\eta(t_k)}^m \delta_j L_j(t_k) D(t_k, T_{j+1}) - K \sum_{j=\eta(t_k)-1}^m \delta_j D(t_k, T_{j+1}) \\ &= \delta_{\eta(t_k)-1} L_{\eta(t_k)-1}(T_{\eta(t_k)-1}) D(t_k, T_{\eta(t_k)}) \\ &+ \sum_{j=\eta(t_k)}^m \left(\frac{D(t_k, T_j)}{D(t_k, T_{j+1})} - 1 + \delta_j b_j \right) D(t_k, T_{j+1}) - K \sum_{j=\eta(t_k)-1}^m \delta_j D(t_k, T_{j+1}) \end{aligned} \quad (\text{式 7 - 1})$$