

勘誤表(97/4/29 更新)

第 32 頁，倒數第 4 行： $x_0 + \mu_t$ 應更正為 $x_0 + \mu t$

第 49 頁，第 1 行與第 2 行裡的 S_t 應更正為 S_T

第 76 頁，第 5 行：Next0 應更正為 Next

第 77 頁，倒數第 4 行： $X_i(i=1\dots n)$ 應更正為 $X_i(i=1, \dots, n)$

第 78 頁，第 5 行： $\sigma \Delta t$ 應更正為 $\sigma \sqrt{\Delta t}$ ；第 7 行： $\sigma(T-t)$ 應更正為 $\sigma \sqrt{T-t}$

第 78 頁，倒數第 4 行： $S_t e^{\sum_{i=1}^n (r-\sigma^2/2)\Delta t + \sigma \sqrt{\Delta t} x_i}$ 應更正為

$$S_t e^{\sum_{i=1}^n (r-\sigma^2/2)\Delta t + \sigma \sqrt{\Delta t} X_i}$$

第 86 頁，第 4 行：Marko Chain 應更正為 Markov Chain

第 100 頁，第 6 行：

$$A(t, T) = \left(2 \frac{\gamma e^{1/2(\alpha+\lambda+\gamma)(T-t)}}{(\alpha + \lambda + \gamma)(e^{\gamma(T-t)} - 1) + 2(\alpha + \lambda + \gamma)} \right)^{2\frac{\alpha\beta}{\sigma^2}} \text{應更正為}$$

$$A(t, T) = \left(2 \frac{\gamma e^{1/2(\alpha+\lambda+\gamma)(T-t)}}{(\alpha + \lambda + \gamma)(e^{\gamma(T-t)} - 1) + 2\gamma} \right)^{2\frac{\alpha\beta}{\sigma^2}}$$

第 100 頁，第 5 行： $C(t, T) = 2 \frac{e^{-\gamma(T-t)}}{(\alpha + \lambda + \gamma)(e^{\gamma(T-t)} - 1) + 2\gamma}$ 應更正為

$$C(t, T) = 2 \frac{e^{\gamma(T-t)} - 1}{(\alpha + \lambda + \gamma)(e^{\gamma(T-t)} - 1) + 2\gamma}$$

第 133 頁，第 7 行： $E_B(\text{Max}(BF_T - K, 0) / B(T, T)) = BFC_t / B(t, T)$ 應更正為
 $E_B(\text{Max}(BF_T - K, 0) / B(T, T)) = BFC_t / B(t, T)$

第 138 頁，兩段法計算隱含波動率的 VB 程式有誤，正確程式請參考網頁模組檔案。

第 153 頁，第 1 行： $0.812 = \frac{[1/(1+0.11e^{\mu_1+\sigma_Y}) + 1/(1+0.11e^{\mu_1-\sigma_Y})]/2}{1+0.1}$ 應更正為

$$0.812 = \frac{[1/(1+0.11e^{\mu_1+\sigma_Y}) + 1/(1+0.11e^{\mu_1-\sigma_Y})]/2}{1+0.1}$$

第 154 頁，第 4 行： $0.712 = \frac{[1/(1+0.12e^{\mu_2+\sigma_Y})^2 + 1/(1+0.12e^{\mu_2-\sigma_Y})^2]/2}{1+0.1}$ 應更正為

$$0.712 = \frac{[1/(1+0.12e^{\mu_2+\sigma_Y})^2 + 1/(1+0.12e^{\mu_2-\sigma_Y})^2]/2}{1+0.1}$$

第 165 頁，第 4 行： $L(t, t, T + 1/4)$ 應更正為 $L(t, T, T + 1/4)$

第 186 頁，第 5 行： ewton 應更正為 newton

第 204 頁，倒數第 7 行： $E[\Delta S_t / S_t] = Pa + (1 - P)b$ 應更正為

$$E[\Delta S_t / S_t] = Pa + (1 - P)b$$

第 224 頁，倒數第 2 行： $dS_t = r S_t dt + \sigma S_t (\rho dw_t^b + \sqrt{1 - \rho^2} d\tilde{w}_t^a)$ 應更正為

$dS_t = r_t S_t dt + \sigma S_t (\rho d\tilde{w}_t^b + \sqrt{1 - \rho^2} d\tilde{w}_t^a)$ ；倒數第 1 行：

$$d \ln S_t = (r - \frac{1}{2} \sigma^2) dt + \sigma (\rho d\tilde{w}_t^b + \sqrt{1 - \rho^2} d\tilde{w}_t^a)$$
 應更正為

$$d \ln S_t = (r_t - \frac{1}{2} \sigma^2) dt + \sigma (\rho d\tilde{w}_t^b + \sqrt{1 - \rho^2} d\tilde{w}_t^a)$$

第 227 頁，第 2 行： $\sigma e^{-\alpha(T-t)}$ ，亦即 $\frac{\partial \sigma_T}{\partial T} = \sigma e^{-\alpha(T-t)}$ 應更正為 $\sigma_B e^{-\alpha(T-t)}$ ，亦即

$$\frac{\partial \sigma_T}{\partial T} = \sigma_B e^{-\alpha(T-t)}$$
，其中 σ_B 為一固定的參數

第 236 頁，倒數第 2 行： $f(x) = \frac{1}{\sqrt{2\pi\sigma y}} e^{-\frac{(\ln y - \mu)^2}{2\sigma^2}}$ ， $0 \leq y < \infty$ 應更正為

$$f(y) = \frac{1}{\sqrt{2\pi\sigma y}} e^{-\frac{(\ln y - \mu)^2}{2\sigma^2}}, 0 < y < \infty$$