

本書第1刷の第2章において、以下の誤りがありました。  
ご使用に際し、ご不便をおかけしましたことをお詫びし、謹んで訂正いたします。

該当箇所	第1刷の記述	修正内容
102頁 下から4行目の数式	$7151 \times e^{(r-q\frac{\sigma^2}{2})+\sigma\xi}$	$7151 \times e^{(r-q-\frac{\sigma^2}{2})+\sigma\xi}$
106頁 下から2行目	図表 2-29 のフローに	図表 2-28 のフローに
119頁 図表 2-45 2行目	「オプション価値のボラティリティ」が高い株価領域 「オプション価値のボラティリティ」が高い株価領域	「オプション価値のボラティリティ」が高い株価領域 「オプション価値のボラティリティ」が低い株価領域
130頁 図表 2-58 右欄	2015年10月1日時点で	2017年10月1日時点で
159頁 下から2行目	HBS フレームワークでは2年後に	BS フレームワークでは1年後に
161-162頁	(3) 1年後に1株もらえる権利の～	(3) 2年後に1株もらえる権利の～ 以降、この節内の1年は2年の誤り
161頁 下から2行目	現物株「1/株カレントイールド」株分に相当する	現物株「 $1/(1+\text{株カレントイールド})^2$ 」株分に相当する
176頁 図表 2-122 2行目	図表 2-116 における8年無リスク金利	図表 2-117 における8年無リスク金利

該当箇所	第1刷の記述	修正内容
182 頁 本文下から 6 行目	オプションの価格 $t$ は、	オプションの価格は、
183 頁 (式 5) の解説文末行	普通関数 (脚注 20、22) であることに注意	普通関数 (脚注 18、20) であることに注意
185 頁 下から 2 行目	—	式の 3 行目末尾に $\times 0.001$ を追加
186 頁 (式 8)	—	式の 2 行目以降各行の末尾に $\times 0.001$ を追加
186 頁 (1) 末尾 4 行目	伊藤の補題は通常、式 6 の一段目	伊藤の補題は通常、式 5 の一段目
186 頁 (1) 末尾 2 行目	式 5 の積み上げ手順を	式 8 の積み上げ手順を