

ERRATUM

Nous collectons dans ce document quelques petites erreurs (resp. commentaires) qui doivent être corrigées (resp. qui peuvent aider) au moment de la lecture du livre.

- Notations générales: Pour deux ensembles $A, B \in \mathcal{F}$, on écrit $A = B$ si $\mathbb{P}[(A \setminus B) \cup (B \setminus A)] = 0$. On travaille toujours à des ensembles négligeables près.
- p19 et 20: dans la preuve de la Proposition 1.8, ρ_n et ρ_* sont des variables aléatoires positives.
- p54 Section 7.6: le temps va de 0 à T^* , $\mathbb{T} = \{0, \dots, T^*\}$.
- p82 Remarque 2.34: La formule de la dérivée de Malliavin indiquée n'est valable (en général) que si α est déterministe. Elle est plus compliquée dans le cas général.
- p140 Exemple 4.1 : les fonctions \bar{b} et $\bar{\sigma}$ peuvent être choisies par exemple C^1 avec une dérivée première à support compact pour que l'eds ait une solution.
- p142 : Dans l'équation (4.4) $W^{\mathbb{Q}}$ est un \mathbb{Q} -mouvement Brownien possiblement sur un nouvel espace de probabilité $(\hat{\Omega}, \hat{\mathcal{F}}, \mathbb{Q})$. Ici, on peut prendre $(\hat{\Omega}, \hat{\mathcal{F}}) = (\Omega, \mathcal{F})$.
- p194 (5.18): Doit être remplacé par

$$\sup_{\underline{\sigma} \leq \sigma \leq \bar{\sigma}} p_{BS}^g(\sigma) \leq p^g, \quad (0.1)$$

et

$$p_{BS}^g(\bar{\sigma}) = p^g \quad \text{si } g \text{ est convexe} \quad , \quad p_{BS}^g(\underline{\sigma}) = p^g \quad \text{si } g \text{ est concave.}$$

- p194, 1. de la preuve de la Proposition 5.13: remplacer $\partial_t \varphi = 0$ par $-\partial_t \varphi = 0$.
- p205 : $y > p(t, z)$ doit être remplacé par $v > p(t, z)$ et $\phi \mathbf{1}_{[t, \theta^\phi]} + \mathbf{1}_{[\theta^\phi, T]}$ doit être remplacé par $\phi \mathbf{1}_{[t, \theta^\phi]} + \bar{\phi} \mathbf{1}_{[\theta^\phi, T]}$.

- p209: (GDPP1) au lieu de (GDPP2) avant (6.8). Par la suite, remplacer $\mathbf{1}_{\theta=\theta^1}$ par $\mathbf{1}_{\theta<\theta^2}$.
- p211 dans (6.10): remplacer v par v' dans la dernière inégalité.
- p216: remplacer $(p-\varphi)(t_n, z_n) = (g-\varphi)(z_n) - \|z-z_n\|^{4\bar{q}} \rightarrow (g-\varphi)(z) = (g-p_T)(z) > 0$ par $(p-\varphi)(t_n, z_n) = (g-\varphi)(z_n) - \|z-z_n\|^{4\bar{q}} \rightarrow (g-\varphi)(z) = (g-p_T)(z) < 0$.
- p221: dans la définition de $\mathcal{N}[p]$, a est à valeurs dans \mathbb{R}^n , i.e.

$$\mathcal{N}[p](t, v, z, m) := \{(u, a) \in K \times \mathbb{R}^n : \Delta_Z \sigma^u[p](t, v, z) = a' \partial_m p\}.$$

- p231 question 2.b: la dynamique de $Q^{t,q}$ est $Q^{t,q} = q + \int_t^{\cdot} \frac{\mu}{\sigma} Q_s^{t,q} dW_s^{\mathbb{Q}_t}$, et $W_s^{\mathbb{Q}_t} = W_s + \frac{\mu}{\sigma} s$.
- p262 ligne 8 depuis le bas de page: Dans la dynamique de $V^{v,\phi}$, $\partial_y^2 p$ doit évidemment être remplacé par $\partial_y p$.