

勘误表.

1. P11. 1 2行, $\lim_{n \rightarrow \infty} \frac{\eta_n(\omega)}{n} = 0$.

2. P16. 1 8行, $\mathbb{E}X$ 公

$$\cdots \int_0^1 xp_{X|Y}(x|y)dx,$$

3. P29. 1 3个 \bar{O} 占行 $\mathbb{E}X$ 公,

$$P(f(i, U_n) = j) = \dots\dots$$

4. P35. 例1.2.5中 方程

$$\begin{cases} \pi_0 p_{00} + \pi_1 p_{10} = \pi_0, \\ \pi_0 p_{01} + \pi_1 p_{11} = \pi_1. \end{cases}$$

5. P37. 1 8行, m边 $\cup \pi_i p_{i, i-1} = \pi_i \lambda / (\lambda + 1)$.

1 3 ~ 4行, \int 除 “粒子I A中 ..., 总流量为 $\pi_i \frac{\lambda}{\lambda+1}$.”

6. P72. 1 7行,

$$P_i(B|C) = P(X_{m+r} \neq i, 1 \leq r \leq n-1; X_{n+m}|X_m = i)$$

7. P73. 公 (1.5.4) 1 二行,

$$P_i(\sigma_i = \infty) > 0 \Leftrightarrow P_i(V_i < \infty) = 1 \Leftrightarrow E_i V_i < \infty.$$

8. P78. 习题1(1). $C \subseteq D$.

9. P109. 习题9(2), $\varphi(a) = e^{aq}(pe^{-a} + 1 - p)$.

10. P121. 前两行. $d_o = 3$. $\pi_o = d_o/508$, \int 除后 $= 1/254$, 而 $ET = 1/\pi_o = 508/3$.

11. P129. 习题3. $\{E_i \sum_{n=0}^{\infty} \mathbf{1}_{rX_n=jg} : j \in S\}$

12. P133. 1 6行, $A_j = \{(j, k) : k \in S\}$.

13. P173. 推论2.2.6. 证 1 2行, \acute{e} ? 意 $n \geq 1, d(o, \hat{X}_n) \leq n$. $\cup \dots$

14. P189. 习题3. $q_{ii} = -(\lambda + \mu)$.

15. P214. 题3.1.2中 $\vec{X}, \vec{X}_r, \vec{X}_1, \vec{X}_n$ 改为 $\mathbf{X}, \mathbf{X}_r, \mathbf{X}_1, \mathbf{X}_n$.

16. P217. 题3.2.8叙 1 2行, “ d 维正交矩阵,”

17. P222. 习题3 (2) $E(B_s^3 - 3sB_s|B_t = x)$.

18. P234. 1 7行. $\leq 2P_0(M_1 > x) \cdots$

19. P236. 1 4行, $1/(\pi\sqrt{s(t-s)})$

20. P238.

$$C_+ := \{t > 0 : B_t = 0 \text{ 且 } \exists \delta > 0, B_s \neq 0, \forall s \in (t - \delta, t)\}.$$

21. P239. í 除习题3. (, 题3.4.7)

22. P241. 我 总b

$$a \leq x \leq b, \{B_t : t \geq 0\} \text{ I } x \text{ 出发 布朗运}\ddot{A}.$$

23. P246-247. 二、高维情形 \mathcal{A} 其 $\mathbf{A} \wedge, \wedge \vec{x}, \vec{y}, \vec{B}_t$.

24. P248. 1 5 ~ 7 行.

$$4zF''(z) + 2dF'(z) = 4zG''(z) + 2dG'(z).$$

d φ 在区• D 内

$$2zG''(z) + dG'(z) = 0, \forall z \in (\varepsilon^2, R^2).$$

25. P250. 1 2 ~ 5 行.

$$\psi(x) = \begin{cases} h(x), & y \leq x \leq z; \\ \frac{x}{y}h(y), & 0 \leq x \leq y; \\ \frac{1}{1-x}h(z), & z \leq x \leq 1, \end{cases}$$

其中, $h(x) = -x^2 + ax + b$, $a \neq b$ 为 $-\frac{1}{2}$ 常 .

26. P251. 习题4. $\tau := \inf\{t \geq 0 : \|\vec{B}_t\| = 1\}$.

27. P254. 1 8 行.

b $\{B_t : t \geq 0\}$ 布朗运 \ddot{A} , $\alpha \neq 0$.

28. P258. 1 6 ~ 7 行.

$$\sum_{i=0}^{n-1} f_{t_i}(B_{t_{i+1}} - B_{t_i}) \xrightarrow{L^2} X_T, \forall T \geq 0.$$

d , 也 \Rightarrow d 4限 X_T P为 $\int_0^T f_t dB_t$.