

## Dérivés de crédit vanille et exotiques : errata

- p. 40 Eq. (2.8) Remplacer  $f(t) = \mathbb{I}_{\tau > 0} \lambda e^{-\lambda t}$  par  $f(t) = \mathbb{I}_{t > 0} \lambda e^{-\lambda t}$
- p. 102 Eq. (5.28) Remplacer  $H_t = H \exp\left(-\int_0^t (r - \beta \sigma_s^2) ds\right)$  par  $H_t = H \exp\left(-\int_0^t (r - \beta \sigma_s^2) ds\right)$
- p. 117 Eq. (7.3) Remplacer  $M_t = (L_T - K_A)^+ - (L_T - K_D)^+$  par  $M_t = (L_t - K_A)^+ - (L_t - K_D)^+$ . On peut alors remarquer que

$$N_t = K_D - K_A - M_t$$