

勘误表.

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

2. P16. 1 8行,  $\mathbb{E}$ 公<sup>a</sup>

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

3. P29. 1 3个 $\bar{O}$ 占行  $\mathbb{E}$ 公<sup>a</sup>,

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

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  $\cup \pi_i p_{i, i-1} = \pi_i \lambda / (\lambda + 1)$ .

$\hat{\epsilon}$  1 3 ~ 4行,  $\bar{f}$  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<sup>a</sup> (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).  $\bar{f} \quad C \subseteq D$ .

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

10. P121. 前两行.  $d_o = 3$ .  $\pi_o = d_o/508$ ,  $\bar{f}$  除后  $\bar{f} = 1/254$ ,  $\bar{f}$  而  $ET = 1/\pi_o = 508/3$ .

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

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

13. P173. 推论2.2.6. 证<sup>2</sup> 1 2行,  $\hat{\epsilon}$ ? 意  $n \geq 1, d(o, \hat{X}_n) \leq n$ .  $\cup \bar{f} \dots$

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

15. P214.  $\cdot$  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.  $\cdot$  题3.2.8叙 $\bar{a}$  1 2行, “ $\bar{f}$   $d$  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.  $\leq 2P_0(M_1 > x) \dots$

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

20. P238.

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

21. P239. 除习题3. ( 题3.4.7)

22. P241. 我, 总

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

23. P246-247. 二、高维情形 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  $\varphi$  在区  $\bullet D$  内 .....

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

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

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

27. P254. 1 8 行.

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

28. P258. 1 6 ~ 7 行.

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

d  $\dot{z}$ , 也 d 限  $X_T$  为  $\int_0^T f_t dB_t$ .