勘误表.

1. P11. 倒数第2行, $\lim_{n\to\infty} \frac{\eta_n(\omega)}{n} = 0$.
2. P29. 第3个独占行的大公式,

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

3. P37. 第8行, 右边等于 $\pi_i p_{i,i-1} = \pi_i \lambda/(\lambda+1)$.
   倒数第3 ~ 4行, 删除 "粒子从 A 中 ..., 总流量为 $\pi_i \frac{\lambda}{\lambda+1}$."
4. P72. 第7行,

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

5. P73. 公式 (1.5.4) 第二行,

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

6. P78. 习题1(1). 使得 $C \subseteq D$.
7. P109. 习题9(2), $\varphi(a) = e^{aq}(pe^{-a} + 1 - p)$.
8. P121. 前两行. $d_o = 3$. $\pi_o = d_o/508$, 删除后面的 $= 1/254$, 从而 $ET = 1/\pi_0 = 508/3$.
9. P129. 习题3. $\{E_i \sum_{n=0}^{\sigma-1} \mathbf{1}_{\{X_n=j\}} : j \in S\}$
10. P133. 第6行, $A_j = \{(j,k) : k \in S\}$.
11. P173. 推论2.2.6. 证明第2行, 对任意 $n \geq 1$, $d(o, \hat{X}_n) \leq n$. 于是...
12. P189. 习题3. $q_{ii} = -(\lambda + \mu)$.
13. P214. 命题3.1.2 中的 $\vec{X}$, $\vec{X}_r$, $\vec{X}_1$, $\vec{X}_n$ 改为 $\mathbf{X}$, $\mathbf{X}_r$, $\mathbf{X}_1$, $\mathbf{X}_n$.
14. P217. 命题3.2.8 叙述第2行, "是 d 维正交矩阵,"
15. P222. 习题3 (2) $E(B_s^3 - 3sB_s|B_t = x)$.
16. P238.

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

17. P239. 删除习题3. (见命题3.4.7)
18. P241. 我们总假设

$$a \leq x \leq b, \quad \{B_t : t \geq 0\}\ \text{是从}\ x\ \text{出发的布朗运动}.$$

19. P246-247. 二、高维情形及其应用, 用 $\vec{x}$, $\vec{y}$, $\vec{B}_t$.

20. P248. 第 5 ~ 7 行.

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

由 $\Delta\varphi$ 在区域 D 内 ······

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

21. P250. 第 2 ~ 5 行.

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

其中, $h(x) = -x^2 + ax + b$, a 与 b 为待定常数.

22. P254. 第 8 行.

假设 $\{B_t : t \ge 0\}$ 是布朗运动, $\alpha \neq 0$.

23. P258. 第 6 ~ 7 行.

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

此时, 也将此极限 X_T 记为 $\int_0^T f_t \mathrm{d}B_t$.