

# Satz um Satz (hüpft der Has)

Beispiel 1.1.1 Beispiele für Nutzenfunktionen	10
Beispiel 2.1.2 Würfel	37
Beispiel 2.1.9 Fortsetzung Würfelbeispiel	39
Satz 2.1.2 Doob's Optional Stopping Theorem	44
Satz 2.1.3 Doob's Optional Sampling Theorem	46
Satz 2.1.3 Doob's Martingale Convergence Theorem	47
Beispiel 2.2.1 Preisbestimmung einer europäischen Call-Option	48
Satz 2.5.4 Erster Fundamentalsatz der Preistheorie	61
Satz 2.6.1 Zweiter Fundamentalsatz der Preistheorie	64
Beispiel 2.10 Amerikanische Call-Option	72
Beispiel 2.10 Amerikanische Calloption	74
Satz 2.11 Spiegelungsprinzip	79
Satz 2.11 Spiegelungsprinzip unter $Q$	80
Beispiel 2.11 Up-and-In-Call	81
Beispiel 2.11 Up-and-Out-Call-Option	82
Beispiel 2.11 Lookback-Put-Option	82
Beispiel 3.1.1 Apfelbäume	85



# Stichwortverzeichnis

- äquivalente Maße, 35
- absolut stetig, 35
- adaptierter Prozess, 40
- Akzeptanzmenge, 29
- Arbitrage-Strategie, 52
- Arbitragepreisprozess, 63
- Archimedeseigenschaft, 9
- Arrow-Debreu-Preissystem, 69
- bedingte Erwartungswert, 37
- bedingte Wahrscheinlichkeit, 37
- dicht, 7
- dynamische Programmierung, 85
- effizientes Portfolio, 18
- erreichbar, 52
- Filtration, 40
- filtrierter Wahrscheinlichkeitsraum, 40
- Gewinnprozess, 52
- Grenzportfolio, 16
- Hedging-Strategie, 52
- Indifferenzrelation, 7
- ineffizientes Portfolio, 18
- Kapitelmarktgeraden, 20
- kohärentes Risikomaß, 29
- konsistentes Preissystem, 67
- Lotterie, 8
- Marktportfolio, 22
- Marktrisikoprämie, 20
- Martingal-Transformation, 42
- Martingalmaß, 58
- Minimum-Varianz-Portfolio, 18
- monotone Präferenzrelation, 9
- natürliche Filtration, 40
- numerische Repräsentation, 7
- Nutzenfunktion, 10
- Portfolio-Return, 15
- Portfoliogrenze, 16
- Portfoliovektor, 15
- Präferenzrelation, 7
- Preissystem, 67
- Radon-Nikodym-Ableitung, 35
- Reservations-Bid-Preis, 13
- risikoaverse Präferenzrelation, 9
- Risikoaversionskoeffizient
  - absoluter, 12
  - relativer, 12
- Risikomaß
  - konvexes, 28
  - monetäres, 28
- risikoneutrales Maß, 14, 58
- Risikoprämie, 10
- selbstfinanzierend, 50
- Sicherheitsäquivalent, 10
- Snell-Einhüllende, 72
- Stochastische Dominanz
  - erster Ordnung, 27
  - zweiter Ordnung, 24
- stochastischer Prozess, 40
- Tangentialportfolio, 20
- Unabhängigkeitseigenschaft, 9
- vollständiger Markt, 52
- von-Neumann-Morgenstern-Repräsentation, 8
- vorhersagbarer Prozess, 42