## Satz um Satz (hüpft der Has)

Beispiel 1.1.1 Reispiele für Nutzenfunktionen
Beispiel 2.1.2Würfel
Beispiel 2.1.9Fortsetzung Würfelbeispiel
Satz 2.1.2 Doob's Optional Stopping Theorem
Satz 2.1.3 Doob's Optional Sampling Theorem
Satz 2.1.3 Doob's Martingale Convergence Theorem
Beispiel 2.2.1 Preisbestimmung einer europäischen Call-Option
Satz 2.5.4Erster Fundamentalsatz der Preistheorie
Satz 2.6.1Zweiter Fundamentalsatz der Preistheorie
Beispiel 2.10. Amerikanische Call-Option
Beispiel 2.10. Amerikanische Calloption
Satz 2.11. Spiegelungsprinzip
Satz 2.11. Spiegelungsprinzip unter Q
Beispiel 2.11. SJp-and-In-Call
Beispiel 2.11. CJp-and-Out-Call-Option
Beispiel 2.11. Lookback-Put-Option
Reispiel 3 1 1 Anfelhäume

## Stichwortverzeichnis

äquivalente Maße, <mark>35</mark>	numerische Repräsentation, 7
	Nutzenfunktion, 10
absolut stetig, 35	
adaptierter Prozess, 40	Portfolio-Return, <mark>15</mark>
Akzeptanzmenge, 29	Portfoliogrenze, 16
Arbitrage-Strategie, 52	Portfoliovektor, 15
Arbitragepreisprozess, 63	Präferenzrelation, 7
Archimedeseigenschaft, 9	Preissystem, 67
Arrow-Debreu-Preissystem, 69	
	Radon-Nikodym-Ableitung, 35
bedingte Erwartungswert, 37	Reservations-Bid-Preis, 13
bedingte Wahrscheinlichkeit, 37	risikoaverse Präferenzrelation, 9
	Risikoaversionskoeffizient
dicht, 7	absoluter, <mark>12</mark>
dynamische Programmierung, <mark>85</mark>	relativer, <mark>12</mark>
60 to 10 to 11 to	Risikomaß
effizientes Portfolio, 18	konvexes, 28
erreichbar, 52	monetäres, <mark>28</mark>
Eiltration 40	risikoneutrales Maß, 14, 58
Filtration, 40	Risikoprämie, <mark>10</mark>
filtrierter Wahrscheinlichkeitsraum, 40	r
Gewinnprozess, 52	selbstfinanzierend, 50
Grenzportfolio, 16	Sicherheitsäquivalent, 10
Grenzportiono, 10	Snell-Einhüllende, 72
Hedging-Strategie, 52	Stochastische Dominanz
	erster Ordnung, <mark>27</mark>
Indifferenzrelation, 7	zweiter Ordnung, <mark>24</mark>
ineffizientes Portfolio, 18	stochastischer Prozess, 40
Kapitelmarktgeraden, 20	Tangentialportfolio, <mark>20</mark>
kohärentes Risikomaß, 29	
konsistentes Preissystem, 67	Unabhängigkeitseigenschaft, 9
* •	vollständiger Markt, 52
Lotterie, 8	
Mouletnoutfolio 22	von-Neumann-Morgenstern-Repräsentation, 8
Marktportfolio, 22	vorhersagbarer Prozess, 42
Marktrisikoprämie, 20	
Martingal-Transformation, 42	
Martingalmaß, 58	
Minimum-Varianz-Portfolio, 18	
monotone Präferenzrelation, 9	
natürliaha Eiltration 40	
natürliche Filtration, 40	