

Inhaltsverzeichnis

Abkürzungsverzeichnis	XI
Symbolverzeichnis	XIII
Allgemeine Symbole	XIII
Spezifische Symbole	XVI
Einleitung	1
1 Grundlagen der Bewertung derivativer Finanzinstrumente: Der Status Quo	5
1.1 Derivative Finanzinstrumente	5
1.2 Der Zustands-Präferenz-Ansatz	11
2 Die Konsequenzen der Usual Conditions	23
2.1 Zur Vollständigkeit von (Ω, \mathcal{F}, P)	23
2.2 Zur rechtsseitigen Stetigkeit von \mathbb{F}	25
2.3 Zur Vollständigkeit von \mathbb{F}	30
3 Modellierung von Information	33
3.1 Eine bemerkenswerte σ -Algebra	33
3.2 Der in der Spieltheorie übliche Ansatz: Informations-Partitionen	37
3.3 Partitionen vs. σ -Algebren	46
4 Die Bedeutung von \mathcal{F} und P	53
4.1 Wie interpretiert man \mathcal{F} ?	53
4.2 Welche Bedeutung kommt P zu?	58
5 Eine alternative Modellierung	59
5.1 Ein (fast) wahrscheinlichkeitsfreier Ansatz	60
5.2 σ -Algebren, die von Partitionen stammen	65
5.3 Zusammenfassung des Modells	71
	IX

6	Stochastische Integration	75
6.1	Elementare Handelsstrategien und Eigenschaften des Preisprozesses S	78
6.2	Semimartingale	91
6.3	Allgemeine Handelsstrategien und ihr Handelserfolg	96
6.4	Die Semimartingal-Topologie sowie noch allgemeinere Handelsstrategien und deren Handelserfolg	107
6.5	Der Zusammenhang mit dem Integral unter den Usual Conditions	116
7	Komplettierung des Modells	125
7.1	Zulässige Handelsstrategien und Arbitrage	125
7.2	Bewertung von derivativen Finanzinstrumenten	130
8	Fazit und Ausblick	133
A	Mathematischer Anhang	137
A.1	Zu Kapitel 1	137
A.2	Zu Kapitel 3	141
A.2.1	Zu Abschnitt 3.1	141
A.2.2	Zu Abschnitt 3.2	146
A.2.3	Zu Abschnitt 3.3	148
A.3	Zu Kapitel 5	151
A.3.1	Zu Abschnitt 5.1	151
A.3.2	Zu Abschnitt 5.2	152
A.4	Zu Kapitel 6	154
A.4.1	Zu Abschnitt 6.1	154
A.4.2	Zu Abschnitt 6.3	155
A.4.3	Zu Abschnitt 6.4	157
A.4.4	Zu Abschnitt 6.5	160
	Literaturverzeichnis	161