

## Inhalt

1.	Einleitung/Problemstellung	1
2.	Reduktion der Strategiemenge des Propheten	8
	a) Die Balayage-Technik	8
	b) Reduktion auf Supermartingale	13
<u>I.</u>	<u>Der allgemeine Fall</u>	
3.	Martingale	17
	a) Zeitdiskrete Martingale mit endlichem Horizont	17
	b) Zeitdiskrete Martingale mit unendlichem Horizont	27
	c) Zeitstetige Martingale mit rechtsseitig stetigen Pfaden	34
	d) Ergänzungen	46
4.	Allgemeine stochastische Prozesse	49
	a) Endliche Folgen von $[0; 1]$ -wertigen Zufallsgrößen	49
	b) Unendliche Folgen von $[0; 1]$ -wertigen Zufallsgrößen	59
	c) Zeitstetige Prozesse mit rechtsseitig stetigen Pfaden	67
	d) Ergänzungen	71
<u>II.</u>	<u>Der unabhängige Fall</u>	
5.	Folgen von stochastisch unabhängigen Zufallsgrößen	74
	a) Prophetenregionen und Prophetenungleichungen	74
	b) Extremale Verteilungen	82
	c) Die Spielwerte	86
	d) Ergänzungen	88
6.	Zeitlich bewertete Auszahlungen im unabhängigen Fall	91
	a) Zeitlich bewertete Auszahlungen; Reduktionen	91
	b) Prophetenregionen bei zeitlichen Bewertungen	99
	c) Diskontierung	112
	d) Lineare Beobachtungskosten	118
	e) Diskontierung und Beobachtungskosten	126

<u>III.</u>	<u>Unabhängige Versuchswiederholungen (der iid-Fall)</u>	
7.	Folgen von stochastisch unabhängigen, identisch verteilten Zufallsgrößen	132
	a) Reduktion auf diskrete Verteilungen; analytische Hilfsfunktionen	132
	b) Prophetenregionen und Prophetenungleichungen	144
8.	Zeitlich bewertete Auszahlungen im iid-Fall	173
	a) Diskontierung	173
	b) Enddiskontierung beim Propheten	177
	c) Lineare Beobachtungskosten	184
	Literatur	200
	Index	208