Korrekturen für *Stochastische Prozesse und Finanzmathematik*
Ludger Rüschendorf
Springer 2020

zuletzt geändert: 31. März 2023

red = zu ersetzen, grün = einzufügen

page	**diesen Text ersetzen**	**korrekter Text**
47^6	*d)* Sei $Y_t =$ ...	*e)* Sei $Y_t =$ ...
52^{11}	Martigalen	Martingalen
54^4	$=: a \quad \Delta\Delta' \longrightarrow 0$	$=: a_{\Delta\Delta'} \longrightarrow 0$
63_6	$E\int_0^\infty \vert H_sK_s\vert \, d\vert\langle M,N\rangle\vert_s \leq$	$E\int_0^\infty \vert H_sK_s\vert \, \mathrm{d}\vert\langle M,N\rangle\vert_s \leq$
64^6	(M_t)	$(M_t)_{t\leq\infty}$
83^{14}	$\vert\Delta_n = \vert \longrightarrow 0$	$\vert\Delta_n\vert \longrightarrow 0$
114_5	Jedes L-Funktional ...	Jedes L^2-Funktional ...
125^6	... $\vartheta_0 \in \mathbb{R}, \varphi \in \mathcal{L}^2(\mu)$.	... $\vartheta_0 \in \mathbb{R}, \varphi \in L^2(\mu)$.
130^{12}	$\dots = \int \frac{\partial}{\partial u} \dots \in U_\varepsilon(0)$.	$\dots = \int \frac{\partial}{\partial u} \dots, \quad u \in U_\varepsilon(0)$.
134_{12}	**Korollar 4.46** [Bayessche Formel für bedingte Erwartungswerte]	**Korollar 4.46 (Bayessche Formel für bedingte Erwartungswerte)**
141^{11}	... $= (\widetilde{B} - B) + \langle\beta, L\rangle_t \in S_c(W_h)$,	... $= (\widetilde{B} - B) + \langle\beta, L\rangle_t \in \mathscr{S}_c(W_h)$,
155^{10}	... in Varianz ...	... in Verteilung ...
198_5	$p(x,t,K,\sigma)\sim$ bezeichne den Preis ...	$p(x,t,K,\sigma)$ bezeichne den Preis ...
199_5	c3) $\frac{\partial p}{\partial t} = Ke^{-rt}\Big(r\Phi(d_2) + \frac{\sigma\varphi(d_2)}{2\sqrt{t}}\Big) > 0. \quad (5.5)$	c3) $\frac{\partial p}{\partial t} = Ke^{-rt}\Big(r\Phi(d_2) + \frac{\sigma\varphi(d_2)}{2\sqrt{t}}\Big) > 0. \quad (5.5)$
200^4	c5) $\frac{\partial p}{\partial r} = Kte^{-rt}\Phi(d_2) > 0. \quad (5.6)$ c6) $\frac{\partial p}{\partial K} = -e^{-rt}\Phi(d_2) < 0, \quad (5.7)$	c5) $\frac{\partial p}{\partial r} = Kte^{-rt}\Phi(d_2) > 0. \quad (5.6)$ c6) $\frac{\partial p}{\partial K} = -e^{-rt}\Phi(d_2) < 0, \quad (5.7)$
209^{10}	$\varphi_t := h(S_t, t).$	$\varphi_t := h(S_t, t)$

page	diesen Text ersetzen	korrekter Text
215_2	... d.h. $f_A = c + \int_0^T \vartheta_t \, \mathrm{d}S_t$.	... d.h. $1_A = c + \int_0^T \vartheta_t \, \mathrm{d}S_t$.
217^2	Satz 5.31	Satz 5.13
222^{11}	c) $(L(S), d)$ ist ein vollständiger ...	c) $(\mathcal{L}(S), d)$ ist ein vollständiger ...
236^2	... $u(x) = 1 - e^{-x} \log x$ der u^*-Divergenz-Abstand ...	... $u(x) = 1 - e^{-x}$ der u^*-Divergenz-Abstand...
256_{14}	... für $t \in (0, T]$.	Text gelöscht
257^5	... inverse relative Entropie besitzen. ...	... reverse relative Entropie besitzen. ...
257^9	... inverse relative Entropie minimiert. ...	... reverse relative Entropie minimiert. ...
286^6	Seminar on Stochastic analysis, random fields and applications. Centro Stefano Franscini, Ascona, Italy, September 1996	Seminar on Stochastic Analysis, Random Fields and Applications. Centro Stefano Franscini, Ascona, Italy, September 1996
287^2	J. Jacod. Intégrales stochastiques par rapport à une semimartingale vectorielle et changements de filtration. Séminaire de probabilités XIV 1978/79: 161–172, 1980	J. Jacod. Integrales stochastiques par rapport a une semimartingale vectorielle et changements de filtration. Séminaire de Probabilités XIV 1978/79: 161–172, 1980