

Inhaltsverzeichnis

Symbolverzeichnis	xi
1. Einführung	1
1.1. Optimales Stoppen	1
1.2. Static Forecasting	13
1.3. Zielsetzung und Aufbau der Arbeit	21
2. Static Forecasting	25
2.1. Wichtige Definitionen und Problemstellung	25
2.2. Definition der Schätzer	29
2.3. Resultate zur schwachen universellen Konsistenz	35
2.4. Wahl der Funktionenräume	38
2.5. Beweis von Satz 2.2	47
2.6. Universelle Vorhersage	76
3. Optimales Stoppen	81
3.1. Vom optimalen Stoppen zum Static Forecasting	81
3.2. Definition der Schätzer	84
3.3. Resultate zum optimalen Stoppen und Folgerungen	88
3.4. Beweis von Satz 3.1	90
4. Optimales Ausüben von Amerikanischen Optionen	109
4.1. Einführung	109

Inhaltsverzeichnis

4.2. Resultat zum optimalen Ausüben von Amerikanischen Optionen	117
4.3. Simulationsstudie	120
5. Ausblick und offene Fragen	143
A. Hilfsresultate	151
B. Reguläre bedingte Verteilungen	157
C. Beweis von Lemma 2.5	159