



## Martingale in Diskreter Zeit: Theorie und Anwendungen (Springer-Lehrbuch Masterclass) (German Edition)

*Harald Luschgy*

 **Download**

 **Online Lesen**

**Martingale in Diskreter Zeit: Theorie und Anwendungen (Springer-Lehrbuch Masterclass) (German Edition)** Harald Luschgy

 [Download Martingale in Diskreter Zeit: Theorie und Anwendungen \(...pdf\)](#)

 [Online Lesen Martingale in Diskreter Zeit: Theorie und Anwendungen \(...pdf\)](#)

# **Martingale in Diskreter Zeit: Theorie und Anwendungen (Springer-Lehrbuch Masterclass) (German Edition)**

*Harald Luschgy*

**Martingale in Diskreter Zeit: Theorie und Anwendungen (Springer-Lehrbuch Masterclass) (German Edition)** Harald Luschgy

**Downloaden und kostenlos lesen Martingale in Diskreter Zeit: Theorie und Anwendungen (Springer-Lehrbuch Masterclass) (German Edition) Harald Luschgy**

---

468 Seiten

Kurzbeschreibung

Martingale haben die Wahrscheinlichkeitstheorie derart revolutioniert, dass die Suche nach 'guten' Martingalen inzwischen eine Standardmethode zur Untersuchung stochastischer Probleme ist. Das Buch führt in die Theorie der reellen Martingale in diskreter Zeit ein und zeigt in Teil 2 einige ihrer Anwendungen; dazu zählen u. a. das finanzmathematische Problem der Optionsbewertung, der Galton-Watson-Verzweigungsprozess, U-Statistiken und die unbedingte Basiseigenschaft von Martingal-Basen in  $L_p$ -Räumen. Mit zahlreichen Übungsaufgaben zu jedem Kapitel. Buchrückseite

Dieses Lehrbuch bietet neben einer umfassenden Darstellung der Theorie der Martingale in diskreter Zeit auch ausführliche Anwendungen. Die behandelten Themen reichen von klassischem Material über Zerlegungen von stochastischen Prozessen und Submartingalen, quadratische Variation und quadratische Charakteristik, Kompensatoren und Potentiale, Stoppzeiten und gestoppte Prozesse, Ungleichungen, Konvergenz und lokale Konvergenz, starke Gesetze der großen Zahlen, Gesetze vom iterierten Logarithmus und den Zusammenhang mit Markov-Prozessen bis zu neueren Ergebnissen über exponentielle Ungleichungen, einen stabilen zentralen Grenzwertsatz mit exponentieller Rate und die optionale Zerlegung universeller Supermartingale. Die Anwendungen betreffen etwa das finanzmathematische Problem der Optionsbewertung, Verzweigungsprozesse und stochastische Approximationsalgorithmen. Mehr als 170 Übungsaufgaben ergänzen die Darstellung. In der deutschsprachigen Literatur findet man kein vergleichbares Buch. Über den Autor und weitere Mitwirkende

Prof. Dr. Harald Luschgy, Universität Trier, Department Mathematik

Download and Read Online Martingale in Diskreter Zeit: Theorie und Anwendungen (Springer-Lehrbuch Masterclass) (German Edition) Harald Luschgy #XV0PIJSRDO7

Lesen Sie *Martingale in Diskreter Zeit: Theorie und Anwendungen* (Springer-Lehrbuch Masterclass) (German Edition) von Harald Luschgy für online ebook *Martingale in Diskreter Zeit: Theorie und Anwendungen* (Springer-Lehrbuch Masterclass) (German Edition) von Harald Luschgy Kostenlose PDF d0wnl0ad, Hörbücher, Bücher zu lesen, gute Bücher zu lesen, billige Bücher, gute Bücher, Online-Bücher, Bücher online, Buchbesprechungen epub, Bücher lesen online, Bücher online zu lesen, Online-Bibliothek, greatbooks zu lesen, PDF Beste Bücher zu lesen, Top-Bücher zu lesen *Martingale in Diskreter Zeit: Theorie und Anwendungen* (Springer-Lehrbuch Masterclass) (German Edition) von Harald Luschgy Bücher online zu lesen. Online *Martingale in Diskreter Zeit: Theorie und Anwendungen* (Springer-Lehrbuch Masterclass) (German Edition) von Harald Luschgy ebook PDF herunterladen *Martingale in Diskreter Zeit: Theorie und Anwendungen* (Springer-Lehrbuch Masterclass) (German Edition) von Harald Luschgy Doc *Martingale in Diskreter Zeit: Theorie und Anwendungen* (Springer-Lehrbuch Masterclass) (German Edition) von Harald Luschgy Mobipocket *Martingale in Diskreter Zeit: Theorie und Anwendungen* (Springer-Lehrbuch Masterclass) (German Edition) von Harald Luschgy EPub