René Schilling: **Martingale und Prozesse**

De Gruyter, Berlin 2018. ISBN: 978–3–11–035067-8

Druckfehler und kleinere Änderungen. Letzte Änderung: 7. April 2025.

Seite, Zeile	**Stelle im Buch**	**Korrektur**
S. 16, Z. 2 v.o.	$F \in \mathscr{A}$	$F \in \mathscr{F}$
S. 16, Z. 3 v.o.	$\omega \in \Omega$	$\omega \in F$
S. 16, Aufg. 18	$p, q \in [0, \infty]$	$p, q \in [1, \infty]$
S. 30, Aufg. 10	$(X_n)_{n\in\mathbb{N}}$ und $\mathscr{F}_n = \sigma(S_0, \dots, S_n)$	$(X_n)_{n\in\mathbb{N}_0}$ und $\mathscr{F}_n = \sigma(X_0, \dots, X_n)$
S. 29, Kor. 3.14	$I = C \bullet M$ das einzige L^2-Martingal, das...	$I = C \bullet M$ das einzige L^2-Martingal mit $I_0 = 0$, das...
S. 50, Aufg. 10 Hinweis	$X_n = X_{n-1} - (n-1) + Y_n$, $\mathbb{P}(Y_n = 0) = \frac{1}{n}$, $\mathbb{P}(Y_n = n) = 1 - \frac{1}{n}$	$X_n = X_{n-1} - (n^2 - 1) + Y_n$, $\mathbb{P}(Y_n = 0) = \frac{1}{n^2}$, $\mathbb{P}(Y_n = n^2) = 1 - \frac{1}{n^2}$
S. 56, Aufg. 2(d)	$\lim_{n\to\infty} X_n/\mu^n = \dots$	$\lim_{n\to\infty} \mathbb{V}(X_n/\mu^n) = \dots$
S. 65, Satz 7.14.a)	$\in \mathbb{R}$ existiert f.s.	$\in \overline{\mathbb{R}}$ existiert f.s.
S. 65, Satz 7.14.b)	dann gilt	dann gilt $X_{-\infty} \in \mathbb{R}$ f.s. und
S. 66, Aufg. 1(e)	$(X_i)_{i\in I}$ ggi	$(X_i)_{i\in I}$, $(Y_i)_{i\in I}$ ggi
S. 70, Zeile 1 oben	iid	unabhängig
S. 85, Aufg. 4(c)	$x \in \mathbb{R}$	$x \in \mathbb{Z}$
S. 86, Aufg. 7	$\mathbb{P}_Y \perp \mathbb{P}_Y$	$\mathbb{P}_Y \perp \mathbb{P}_X$
S. 86, Aufg. 9	,X_0.	,$X_0 = 0$.
S. 93, (10.2)	$[X]_0 := X_0$	$[X]_0 := X_0^2$
S. 107, Aufg. 1	$[X, Y]_n := X_0 Y_0 = \sum_{i=1}^n \dots$	$[X, Y]_n := X_0 Y_0 + \sum_{i=1}^n \dots$
S. 108, Aufg. 4	$X_n := 0$	$X_0 := 0$
S. 108, Aufg. 6	Es sei $p \in (1, \infty)$, $(X_n, \mathscr{F}_n)_{n\in\mathbb{N}_0}$	Es seien $p \in (1, \infty)$ und $(X_n, \mathscr{F}_n)_{n\in\mathbb{N}_0}$ ein Martingal.
S. 111, (11.2)	$X_T \in L^2$	$X_T - T\mathbb{E}X_1 \in L^2$
S. 113, Zeile 4 oben	$\mathbb{E}\frac{T_{(a,b)}}{b-a} = \dots$	$\mathbb{E}\frac{T_{(a,b)}}{b-a} \leq \dots$
S. 130, Aufg. 1	$\mathbb{P}(\sigma_{2n} = 2k)$	$\mathbb{P}(T_0 = 2k)$
S. 144, Z. 1 v.u.	$\frac{4}{C}\, r^2$	$\frac{4}{C}\, r^{-2}$
S. 145, Aufg. 2	als Verteilung der	als W-Maß für die
S. 154, Z. 9 & 5 v.u.	=: ρ & ρ	=: ρ^m & ρ^m
S. 154, Z. 4 & 3 v.u.	ρ, ρ^2 & ρ^k	ρ^m, ρ^{2m} & ρ^{km}
S. 160, Z. 10 v.u.	$\mathbb{E}^a[u(X_T)]$	$\mathbb{E}^a[u(X_1)]$
S. 168, Aufg. 9(d)	auf dem Träger von Gv	auf der Menge $\{v > 0\}$ [*Kommentar: in der Potentialtheorie nennt man das den* <u>*Träger*</u> *des Potentials* Gv.]
S. 168, Aufg. 9(e)(iv)	$\{u \neq 0\} \subset B$	$\{\psi \neq 0\} \subset B$ [*Kommentar* ψ *aus Teil* (i)]
S. 168, Aufg. 17	$E^0\sqrt{T_1} < \infty$	$E^0 T_1^\alpha < \infty$ bzw. $= \infty$ für $\alpha < \frac{1}{2}$ bzw. $\alpha = \frac{1}{2}$
S. 168, Aufg. 17	$\dots \leq c/\sqrt{n}$	$\dots \leq cn^{\epsilon - 1/2}$ für alle $\epsilon > 0$