

4. Übungsblatt „Zinsstrukturmodelle“

Hausaufgaben

1. Hausaufgabe:

5 Punkte

Es bezeichne Prog die σ -Algebra der Mengen $A \subset \Omega \times [0, \infty)$ mit der Eigenschaft, dass $(\omega, t) \mapsto \mathbb{1}_A(\omega, t)$ progressiv messbar ist. Benutzen Sie das Monotone-Klassen-Theorem (Thm 6.3) zum Beweis, dass ein Prozess $(X(t))_{t \geq 0}$ genau dann progressiv messbar ist, wenn er Prog-messbar ist.

2. Hausaufgabe:

15 Punkte

Lösen Sie Aufgabe 10.12.