

# Geleitwort

Diese Diplomarbeit ist im Zusammenhang mit einer 2-semesterigen Vorlesung "Finanzmathematik I und II" entstanden.

Auf der Grundlage der Monographie "Stochastische Analysis" von Hackenbroch und Thalmaier ([9]) und anderer Literatur sollte das der Vorlesung zugrunde gelegte Lehrbuch "Finanzmathematik" von Irle ([10]) hinsichtlich stochastischer Integration vertieft werden.

Im Vergleich zu beiden Quellen hat Michael Hoffmann eine Reihe von Vereinfachungen, Vervollständigungen, Verbesserungen und Verallgemeinerungen erzielt.

Herausgekommen ist ein mit durchgehender Konsequenz und Genauigkeit geschriebenes Standardwerk zur stochastischen Integration.

Bayreuth

Prof. Dr. Helmut Rieder



<http://www.springer.com/978-3-658-14131-8>

Stochastische Integration

Eine Einführung in die Finanzmathematik

Hoffmann, M.

2016, XIII, 284 S., Softcover

ISBN: 978-3-658-14131-8