

**6. Aufgabenblatt zur Vorlesung
„Stochastische partielle Differentialgleichungen“**

1. Studieren Sie den Beweis von Proposition 2.3.2 in Prévôt, Röckner (2007).
2. Zeigen Sie

$$\begin{aligned}\mathcal{P}_T &= \sigma(\{Y \in \mathbb{R}^{\Omega_T} : Y \text{ stetig, adaptiert an } (\mathcal{F}_t)_{t \in [0, T]}\}) \\ &= \sigma(\{[s, t] \times F : 0 \leq s < t \leq T, F \in \mathcal{F}_s\} \cup \{\{0\} \times F : F \in \mathcal{F}_0\})\end{aligned}$$

für die σ -Algebra der vorhersagbaren Mengen.

3. Studieren Sie den Beweis von Proposition 2.3.8 in Prévôt, Röckner (2007).
4. Studieren Sie die Fortsetzung des stochastischen Integrals via Lokalisation in Prévôt, Röckner (2007).