

Obsah

Předmluva	v
0. Přípravné výsledky	1
1. Burkholder-Davis-Gundyho nerovnost	23
2. Stochastické diferenciální rovnice: Existence řešení	35
3. Lineární stochastické diferenciální rovnice	51
4. Reprezentace martingalů	69
5. Stochastické diferenciální rovnice: Existence řešení II	109
6. Řešení jako markovský proces	137
7. Exponenciální martingaly	179
Apendix A. Označení	191
Apendix B. Dvě elementární nerovnosti	195
Apendix C. Dodatky k theorii martingalů	197
Apendix D. Gronwallovo lemma	205
Apendix E. Fundamentální matice	207
Apendix F. Spektrální věta pro symetrické matice	221