

# Obsah

Předmluva .....	v
0. Průpravné výsledky .....	1
1. Burkholder-Davis-Gundyho nerovnost .....	23
2. Stochastické diferenciální rovnice: Existence řešení .....	35
3. Lineární stochastické diferenciální rovnice .....	51
4. Representace 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 teorii martingalů .....	197
Apendix D. Gronwallovo lemma .....	205
Apendix E. Fundamentální matice .....	207
Apendix F. Spektrální věta pro symetrické matice .....	221