

Одабрана поглавља случајних процеса - испитна питања

1. Мартингали - локални и семимартингали
2. Процес квадратне варијације
3. Стохастички интеграл елементарног процеса
4. Стохастички интеграл адаптираног процеса
5. Итов интеграл у односу на семимартингал
6. Итова формула и Итови процеси
7. Гирсанова теорема
8. Стохастиче диференцијалне једначине - различите дефиниције решења и јединствености
9. Егзистенција и јединственост строгог решења

др Ана Меркле
јануар 2026.