

Karel Kadlec: Spojité modifikace stochastických procesů.

Posudek vedoucího bakalářské práce

Diplomant se zabývá problémem existence spojitě modifikace stochastického procesu. S porozuměním, velmi podrobně a s citem pro matematickou přesnost reprodukuje důkaz Kolmogorov-Čenstovovy věty pro procesy s hodnotami v \mathbb{R} . Samostatně dokázal Větu 2, která uvažuje proces spojitý podle pravděpodobnosti a uvádí nutnou a postačující podmínku pro existenci spojitě modifikace. V tomto případě jde o řešení jednoho z poměrně obtížných problémů v knize citované v práci jako [2].

Práce je ukončena důkazem velmi obecné a velmi těžké věty Kolmogorov-Čenstovova typu o existenci spojitě modifikace modifikace procesu $(X(t), t \in \mathbb{R}^d)$, který má hodnoty v některém úplném separabilním metrickém prostoru. Ve formulci Věty 3 je specifikace *separabilní* nedopatřením pominuta.

Práce je velmi kvalitní po obsahové i formální stránce, diplomant pracoval samostatně, s invencí a se značnou pracovitostí zvládl základy teorie pravděpodobnosti. Doporučuji přijmout práci pana Kadlece jako bakalářskou na MFF UK.

20.8.2010

Josef Štěpán,

