

Frakcionální Lévyho proces je relativně mladý pojem ze stochastické analýzy. Své využití má především ve fyzice, ale také ve financích, kde s jeho pomocí mohou být modelovány například ceny opcí. Frakcionální Lévyho proces vzniká nahrazením Wienerova procesu v rozkladu Lévyho procesu. Oproti Lévyho procesu ztrácí nezávislost přírůstků a oproti frakcionálnímu Wienerovu procesu ztrácí spojitost trajektorií. Tato práce je z převážné části brána jako kompilační a shrnuje potřebné znalosti pro zkoumání Lévyho procesu a zavedení frakcionálního Lévyho procesu.