

OBSAH

1	ÚVOD	5
1.1	Cíle, přínos a popis práce	6
2	TEORIE STOCHASTICKÝCH DIFERENCIÁLNÍCH ROVNIC	7
2.1	Brownův pohyb a jeho vlastnosti	7
2.2	Itôův integrál	11
2.3	Stochastické diferenciální rovnice	14
2.4	Numerické řešení stochastických diferenciálních rovnic	16
3	STOCHASTICKÉ DIFERENCIÁLNÍ ROVNICE V ELEKTROTECHNICE	18
3.1	Deterministický model RL obvodu	18
3.2	Stochastický model RL obvodu	18
	LITERATURA	23
4	PUBLIKACE AUTORKY	24
5	CV AUTORKY	25
6	ABSTRACT	26