

Tato bakalářská práce se zabývá Girsanovovou větou v diskrétním čase, která má široké uplatnění, například ve finanční matematice nebo teorii filtrů. Tato věta hovoří o konstrukci pravděpodobnostní míry, vůči níž je daný proces martingalem do konečného času. V práci je Girsanovova věta zobecněná i pro jiné typy procesů a je ukázáno, že si tyto výsledky odpovídají. Dále je zkonstruována pravděpodobnostní míra tak, aby byl celý proces vůči této míře martingalem. Na závěr jsou uvedeny některé postačující podmínky pro absolutní spojitost této nové míry vůči té původní.