

Тема: **Мартингали**

Наставник: **Слађана Димитријевић**

Студент треба најпре да мотивише и уведе појам мартингала као специфичне класе случајних процеса. Потом се очекује да посебно обради њихове особине, теореме заустављања и конвергенцију. Излагање материје треба да буде пропраћено илустративним примерима, посебно оним везаним за игре на срећу.

Литература

1. O. Knill, *Probability Theory and Stochastic Processes with Applications*, Overseas Press, India, 2009.
2. J. Малишић, *Случајни процеси*, Грађевинска књига, Београд, 1989.
3. D. Williams, *Probability with Martingales*, Cambridge University Press, Great Britain, 1991.