

Obsah

Jakub Černý Modelování úrokových sazeb	5
Martin Pohl Forward Premium in the Czech Money Market.....	25
Jiří Málek, Jarmila Radová Vliv skoků na cenu bondů ve Vasickových modelech	33
Jaroslav Baran, Jan Voříšek A Note on Multivariate EVT VaR and ES Estimation.....	45
Radomír Míšek Vybrané problémy odhadu parametrů strukturálních modelů kreditního rizika.....	51
Jiří Hron Přímá Monte Carlo simulace závislých kreditních defaultů	61
Jiří Hron Pravděpodobnost defaultu jako funkce kategorie indexu bonity	69
Marek Kolman Portfolio Credit Risk Models	75
Jiří Witzany Estimating Correlated Jumps and Stochastic Volatilities	93
Bohumil Stádník Možnosti predikce budoucího vývoje cen likvidních investičních instrumentů a kvantifikace procentuální převahy	121
Petr Jablonský Optimalizace portfolia za hranicí Markowitzovy teorie	145
Martina Orsáková Economic Capital Modelling	153
Karel Janda, Tomáš Vyležík Financial Management of Weather Risk: Application to Energy Markets.....	163
Quang Van Tran An application of fuzzy control to monetary policy.....	183