



Obsah

Radoslav Míšek Význam defaultní bariéry u strukturálních modelů kreditního rizika	3
Jiří Málek, Jarmila Radová Citlivostní analýza v Hestonově modelu.....	12
Jaroslav Baran, Jiří Witzany A Comparison of EVT and Standard VaR Estimations	27
Jiří Witzany, Michal Rychnovský, Pavel Charamza Survival Analysis in LGD Modeling	49
Martin Pohl Czech Swap Market in the Crisis Period.....	65
Bohumil Stádník Vliv měnící se volatility na pravděpodobnostní rozdělení cen/výnosů investičních instrumentů	85

Zpracováno řešiteli jako výstup grantů 402/09/0380 a 402/09/0732

