

Obsah

Marek Kolman:

Risky Coupon bond Option Pricing. Intensity approach. 5

Jiří Witzany:

A Note on the Vasicek's Model with the Logistic Distribution 21

Zuzana Pumprová:

Short Rate Models and the Heath Jarrow Morton Framework 33

Bohumil Stádník:

Market Price Direction Dependence 47

Jaroslav Baran, Jiří Witzany:

Konstrukce výnosových křivek za přítomnosti swapových spreadů a kolateralizace..... 69

Jiří Málek:

Hedging opcí v Black-Scholesově a Hestonově modelu 101

Patrik Hudec:

Výpočet volatility FX-opcí na vysokofrekvenčních datech s využitím delta hedgingu 113

Adam Felcman:

Value at Risk: historická simulace, variančně kovarianční metoda a simulace Monte Carlo..... 123

Karel Janda, Pavel Zetek:

Opportunities and threats in microfinance risk management..... 145