

Obsah

Jakub Černý, Jiří Witzany

Interest Rate Swap Credit Value Adjustment5

Milan Fičura

Metody předvídání volatility s využitím realizované volatility a tržních cen opcí21

Jiří Málek

Delta-gamma-theta hedging evropských kupních opcí39

Bohumil Stádník

Volatility Clustering with the Resonance.....47

Jiří Witzany

Estimating Default and Recovery Rate Correlations.....61

Jaroslav Baran

Determinants of Cross-currency Basis Spreads.....81

Karel Janda, Batbayar Turbat

Profitability of Microfinance Institutions in Selected Asian Countries.....90

Marek Kolman

A Defaultable Binomial Tree.....103

Štěpán Onder

Využití kvantitativních metod v měření rizik.....127