

Plán výučby – Finančná matematika – Tibenský

- 17.9. – Diskrétné a spojité úrokovanie, diskontovanie
- 24.9. – Európska call a put opcia, Itoova lema
- 1.10. – Black-Scholesova rovnica pre akciu s dividendou aj bez dividendy, podmienky, Mertonove odvodenie
- 8.10. - Analýza citlivosti a opčné stratégie
- 15.10. – Finančné deriváty odvodené od úrokovej miery
- 22.10. – Numerické riešenie Black-Scholesovej rovnice – explicitná schéma
- 29.10. – Numerické riešenie Black-Scholesovej rovnice - implicitná schéma
- 5.11. – Americké opcie – definícia a vlastnosti
- 12.11. – Americké opcie ako príklad problému s voľnou hranicou
- 19.11. – Rôzne prístupy k odhadu volatility, Hestonov model
- 26.11. - Skúška