

Errata

**Analytické a numerické
metódy oceňovania
finančných derivátov**

Daniel Ševčovič

Beáta Stehlíková

Karol Mikula

Slovenská technická univerzita v Bratislave, 2009

str. 29, 12. riadok zdola	doplniť f za operátor $2\nabla_x$, t.j. $2\nabla_x f$
str. 29, 5. riadok zdola	zmeniť indexy $\sum_{k,l=1}^n \sigma_{ik}\sigma_{jl}dw_i dw_j$ na $\sum_{k,l=1}^n \sigma_{ik}\sigma_{jl}dw_k dw_l$
str. 44, text pod (2.31)	doplniť "zníženej o expiračnú cenu E diskontovaných úrokovou mierou r
str. 46, cv. 9(d)	doplniť podmienku $E_2 \leq E_1$
str. 67, 6. a 5. riadok zdola	namiesto $S < E$, resp. $S > E$ má byť $\ln(S/E) + (r-D)(T-t) < 0$, resp. (> 0) .
str. 68, 3. riadok zdola	vynechať "a podobne dolná medza je menšia ako terminálová podmienka"
str. 83, formula (5.1)	správne má byť $C = 2(S_{ask} - S_{bid}) / (S_{ask} + S_{bid})$
str. 99, posledný riadok	pred $f(\frac{S}{A}, t)$ ešte A (teda bude $Af(\frac{S}{A}, t)$)
str. 100, (6.8)	pred $f(\frac{S}{A}, t)$ ešte A (teda bude $Af(\frac{S}{A}, t)$)
str. 108, 12. riadok zdola	vo vzorci pre V^{bin} namiesto $d_1^{E_1}$ a $d_1^{E_2}$ má byť $d_2^{E_1}$ a $d_2^{E_2}$
str. 118, 2. rovnica	namiesto $\phi(s, t) = E(e^{isr(t)}r(t))$ má byť $\phi(s, t) = E(e^{isr(t)})$
str. 120, (7.14)	$1/C$ namiesto C
kap. 8.1.1, str. 132-139	kvôli prehľadnosti sme preznačili trhovou cenu rizika z $\lambda(t, r)$ na $\tilde{\lambda}(t, r)$.
str. 132, (8.1)	má byť $\sigma_B(t, r)dw$ (nie je tam dw)
str. 136, (8.9)	$\lambda\sigma\sqrt{r}$ namiesto $\lambda\sigma r$
str. 137, 2. riadok	namiesto "konštantnú trhovou cenu rizika λ " má byť "pre trhovú cenu rizika $\lambda\sqrt{r}$ "
str. 140, (8.16)	namiesto $\dots\sigma_1\mu(T_3)dw_1$ má byť $\dots V_3\sigma_1(T_3)dw_1$, namiesto $\dots\sigma_2\mu(T_3)dw_2$ má byť $\dots V_3\sigma_2(T_3)dw_2$
str. 140, rovnica pod (8.16)	namiesto $\dots + \sigma_1\mu(T_3) = 0$ má byť $\dots + V_3\sigma_1(T_3) = 0$, namiesto $\dots + \sigma_2\mu(T_3) = 0$ má byť $\dots + V_3\sigma_2(T_3) = 0$
str. 149, 4. riadok	namiesto "nie však je" má byť "však nie je"
str. 149, 5. riadok	pred "a preto" má byť čiarka
str. 152, (9.1)	za $D = 0$ má byť čiarka, nie bodka
str. 164, 11. riadok zdola	namiesto $x = \ln(S/E) \in (0, \infty)$ má byť $x = \ln(S/E) \in (-\infty, \infty)$
str. 171, 2. riadok pod (10.18)	namiesto S_- má byť S_+
str. 172, pbr. 10.3	myslím, že toto si už opravil - vymenené p a q
str. 174, 3. riadok zdola	namiesto $\mathbf{A}^{-1}u_i$ má byť $\mathbf{A}^{-1}u^j$
str. 176, 2. rovnica	namiesto $ b_i - \gamma u_{i-1} - \gamma u_{i+1} $ má byť $ b_i + \gamma u_{i-1} + \gamma u_{i+1} $
str. 176, (10.20)	namiesto $\ A^{-1}b\ _\infty \leq \ u\ _\infty$ má byť $\ A^{-1}b\ _\infty \leq \ b\ _\infty$
str. 179, (10.32)	namiesto $(1 - \omega)Du - \omega U$ má byť $(1 - \omega)D - \omega U$