Literatúra

[BS] F. BLACK and M. SCHOLES: The pricing of options and corporate liabilities. J. Political Economy 81 (1973), 637-654.

[DH] J. N. DEWYNNE, S. D. HOWISON, J. RUPF and P. WILMOTT: Some mathematical results in the pricing of American options., Euro. J. of Applied Mathematics 4 (1993), 381-398.

[D] D. DUFFIE: Dynamic asset pricing theory, Princeton Univ. Press, 1992.

[H] J. HULL: Options, futures and other derivative securities, Prentice Hall, 1989.

[Kw] Y. K. KWOK: Mathematical models of financial derivatives, Springer Verlag, 1998.

[MR] M. MUSIELA and M. RUTKOWSKI: Martingale methods in financial modeling, Springer Verlag, Berlin, New York, 1979.

[L] H. E. LELAND: Options Pricing and Replication with Transactions Costs. Journal of Finance 40 (December 1985), 1283-1301.

[K] M. KRATKA: No Mystery Behind the Smile ;-). Risk Primer, Vol 9/No, 1997, 1-4.

[Š] D. ŠEVČOVIČ: Parciálne diferenciálne rovnice. Skriptá, Univerzita Komenského, 1997.

[KKM] J.KOMORNÍK, M. KOMORNÍKOVÁ, K. MIKULA: Modelovanie ekonomických a finančných procesov. Skriptá, Univerzita Komenského, 1997.

[BCDR] A. L. BRITO, C. CARY, H. DUNDAS, S. P. ROCHA: Finančné trhy. Skriptá, Inštitút bankového vzdelávania, 1997.

[Km] M. KMETIKOVÁ: Krátkodobé stratégie obchodovania s opciami. Diplomová práca, Univerzita Komenského, 1999.

[Sm] M. SPUSTA: Risk zohľadňujúca metodológia oceňovania opcií. Diplomová práca, Univerzita Komenského, 2000.