Errata

- str. 5, část 1.3, oprava:
  realizace kontraktu namísto realizace kontaktu,

- str. 8, zavádění značení, doplnění předpokladu:
  K ... cena podkladového aktiva ($K \geq 0$),
  str. 9, zavádění značení, doplnění předpokladu:
  K ... realizační cena bazického instrumentu ($K \geq 0$),

- str. 8, poslední odstavec, úprava formulace:
  Celkovou hodnotu portfolia v čase T označme π_T. Pak $\pi_T = S_T$.
  str. 12, 6. řádek, úprava formulace:
  Pro celkovou hodnotu portfolia v čase T platí: $\pi_T = ...$,

- str. 11, první odstavec, oprava:
  $K_\tau = K - p$ místo $K_\tau = K - c$,

- str. 15, část 3.1., doplnění významu rizikově neutrálního prostředí:
  V rizikově neutrálním prostředí jsou investoři rizikově neutrální, tedy nevyžadují vyšší očekávaný výnos než z bezrizikových investic jako kompenzaci za vyšší míru rizika, které na sebe přejímají. V reálném světě tento předpoklad samozřejmě neplatí, přesto modely s tímto předpokladem poskytují vhodné odhady. Pokud se totiž u investorů zvýší averze vůči riziku, cena bazického instrumentu poklesne. Vztahy pro výpočet ceny derivátu se ale nezmění, tudíž se rizikové preference investorů promítnou do ceny derivátu prostřednictvím tržních dat na vstupu. Pokud bychom počítali s větší úrokovou mírou než bezrizikovou, započítali bychom vlastně vliv averze vůči riziku duplicitně.

- str. 23, poslední řádek, oprava:
  chybné znaménko u K,

- str. 24, vzorce 3.17, oprava:
  po substituci je σ nahrazeno υ,

- str. 24, část 3.2.1, doplnění tvrzení o volatilitě:
  Volatilita vyjadřuje míru variability ceny bazického instrumentu. Dle Cipry (Praktický průvodce finanční a pojistnou matematikou, 1995) se pro kvantifikaci volatility používá směrodatná odchylka. Méně často se využívá i rozptyl, nebo variační či mezikvartilové rozpětí. V této práci však budeme pro míru variability používat směrodatnou odchylku.