

**UNIVERZITA KOMENSKÉHO
FAKULTA MATEMATIKY, FYZIKY A INFORMATIKY**

Zoznam publikačnej činnosti

RNDr. Beáta Stehlíková, PhD.

AAA Vedecké monografie vydané v zahraničných vydavateľstvách

AAA01 Ševčovič, Daniel 50% - Stehlíková, Beáta 30% - Mikula, Karol 20%: Analytical and numerical methods for pricing financial derivatives. - 1. vyd. - New York : Nova Science Publishers, 2011. - 309 s. - (Mathematics Research Developments)

Recenzované

Lit. 126 záz. n.

ISBN 978-1-61728-780-0

URL: <https://stella.uniba.sk/epc/MF/2011/vtIs000250275.pdf>

Ohlasy (6):

[o1] 2011 Chernogorova, T. - Valkov, R.: A two-level second-order finite difference scheme for the single term structure equation. In: Applications of Mathematics in Engineering and Economics (AMEE'11) : AIP Conference Proceedings ; Vol. 1410. Melville : AIP, 2011, S. 139-146 - CPCI-S ; SCOPUS

[o1] 2011 Koleva, M. N.: Efficient numerical method for solving Cauchy problem for the Gamma equation. In: Applications of Mathematics in Engineering and Economics (AMEE'11) : AIP Conference Proceedings ; Vol. 1410. Melville : AIP, 2011, S.120-127 - CPCI-S ; SCOPUS

[o1] 2012 Koleva, M. N. - Vulkov, L. G.: A kernel-based algorithm for numerical solution of nonlinear PDEs in finance. In: Large-Scale Scientific Computing (LSSC 2011) : Lecture Notes in Computer Science ; Vol. 7116. Berlin : Springer, 2012, S. 566-573 - SCOPUS

[o1] 2012 Zhou, S. - Li, W. - Wei, Y. - Wen, C.: A positivity-preserving numerical scheme for nonlinear option pricing models. In: Journal of Applied Mathematics, 2012, Art. No. 205686 - SCOPUS

[o1] 2013 Koleva, M. N. - Vulkov, L. G.: A second-order positivity preserving numerical method for Gamma equation. In: Applied Mathematics and Computation, Vol. 220, 2013, s. 722-734 - SCOPUS

[o1] 2014 Valkov, R.: Fitted finite volume method for a generalized Black Scholes equation transformed on finite interval. In: Numerical Algorithms, Vol. 65, No. 1, 2014, s. 195-220 - SCI ; SCOPUS

AAB Vedecké monografie vydané v domácich vydavateľstvách

AAB01 Ševčovič, Daniel 50% - Stehlíková, Beáta 30% - Mikula, Karol : Analytické a numerické metódy oceňovania finančných derivátov. - 1. vyd. - Bratislava : Slovenská technická univerzita, 2009. - 200 s.

Lit. 65 záz. n.

ISBN 978-80-227-3014-3

Ohlasy (3):

[o3] 2010 Seinerová, K.: Numerický model oceňování evropské kupní opce. In: Zborník konferencie Veřejná správa 2010. Pardubice : Univerzita Pardubice, 2010, S. 189-192

[o3] 2012 Ďurica, M. - Švábová, L.: Použitie metódy konečných diferencií na stanovenie ceny futures opcií. In: IMEA 2012 Sborník příspěvků 12. ročníku doktorandské konference. Hradec Králové : Univerzita Hradec Králové, 2012, S. 214-219

[o1] 2012 Ďurica, M. - Švábová, L.: Delta and Gamma parameter of the Black model of the futures option pricing. In: Managing and Modelling of Financial Risks : Proceedings of 6th International Scientific Conference, Parts 1-2. Ostrava : VŠBTU, 2012, S. 125-132

ADC Vedecké práce v zahraničných karentovaných časopisoch

ADC01 Stehlíková, Beáta 50% - Ševčovič, Daniel 50%: Approximate formulae for pricing zero-coupon bonds and

their asymptotic analysis

Lit. 7 zázň., 3 tab.

In: International Journal of Numerical Analysis and Modeling. - Vol. 6, No. 2 (2009), s. 274-283

Ohlasy (2):

[o3] 2010 Zhaowen, L.: Trigger rate bond pricing structure by the Monte Carlo method. In: Economic Tribune, No. 6, 2010, s. 212-215

[o3] 2013 Ishimura, N. - Fujita, T. - Nakamura, N.: A model of the instantaneous interest rate in discrete processes. In: Procedia Economics and Finance, Vol. 5, 2013, s. 360

ADC02 Stehlíková, Beáta 50% - Ševčovič, Daniel 50%: On the singular limit of solutions to the Cox-Ingersoll-Ross interest rate model with stochastic volatility

Lit. 9 zázň., 3 obr.

In: Kybernetika. - Vol. 45, No. 4 (2009), s. 670-680

Ohlasy (3):

[o1] 2011 Chernogorova, T. - Valkov, R.: Finite volume difference scheme for a degenerate parabolic equation in the zero-coupon bond pricing. In: Mathematical and Computer Modelling, Vol. 54, No. 11-12, 2011, s. 2659-2671 - SCI ; SCOPUS

[o1] 2011 Gyulov, T. B. - Valkov, R. L.: Classical and weak solutions for two models in mathematical finance. In: Applications of Mathematics in Engineering and Economics (AMEE'11) : AIP Conference Proceedings ; Vol. 1410. Melville : AIP, 2011, S. 195-202 - CPCI-S ; SCOPUS

[o3] 2013 Ishimura, N. - Fujita, T. - Nakamura, N.: A model of the instantaneous interest rate in discrete processes. In: Procedia Economics and Finance, Vol. 5, 2013, s. 360

ADC03 Paraskevova Chernogorova, Tatiana 50% - Stehlíková, Beáta 50%: A comparison of asymptotic analytical formulae with finite-difference approximations for pricing zero coupon bond

Lit. 14 zázň.

In: Numerical Algorithms. - Vol. 59, No. 4 (2012), s. 571-588

Ohlasy (1):

[o1] 2014 Valkov, R.: Fitted finite volume method for a generalized Black Scholes equation transformed on finite interval. In: Numerical Algorithms, Vol. 65, No. 1, 2014, s. 195-220 - SCI ; SCOPUS

ADC04 Zíková, Zuzana 50% - Stehlíková, Beáta 50%: Convergence model of interest rates of CKLS type

Lit. 16 zázň.

In: Kybernetika. - Vol. 48, No. 3 (2012), s. 567-586

[ISCAMI 2012 : International Student Conference on Applied Mathematics and Informatics. Malenovice, 10.-13.5.2012]

Ohlasy (1):

[o3] 2013 Ishimura, N. - Fujita, T. - Nakamura, N.: A model of the instantaneous interest rate in discrete processes. In: Procedia Economics and Finance, Vol. 5, 2013, s. 360

ADE Vedecké práce v ostatných zahraničných časopisoch

ADE01 Stehlíková, Beáta 100%: A simple analytic approximation formula for the bond price in the Chan-Karolyi-Longstaff-Sanders model

Lit. 22 zázň., 3 obr., 3 tab.

In: International Journal of Numerical Analysis and Modeling, Series B. - Vol. 4, No. 3 (2013), s. 224-234

AFC Publikované príspevky na zahraničných vedeckých konferenciách

AFC01 Stehlíková, Beáta : Averaged bond prices in generalized Cox-Ingersoll-Ross model of interest rates

Lit. 14 zázň.

In: 5th Actuarial and Financial Mathematics Day. - Brussel : KVAB, 2007. - S. 77-87

[Actuarial and Financial Mathematics Day. 5th, Brussel, 9.2.2007]

AFC02 Stehlíková, Beáta 50% - Ševčovič, Daniel 50%: On non-existence of a one factor interest rate model for

volatility averaged generalized Fong-Vasicek term structures

Recenzované. - Popis urobený 20.3.2009

Lit. 14 zázň., 2 obr.

In: Czech-Japanese Seminar in Applied Mathematics 2008. - Kyushu : Kyushu University, 2009. - S. 40-48. - (COE Lecture Notes ; Vol. 14)

[CJS 2008 : Czech-Japanese Seminar in Applied Mathematics. 1.-7.9.2008, Miyazaki]

URL: http://arxiv.org/PS_cache/arxiv/pdf/0811/0811.0473v1.pdf

POZNÁMKA: Vyšlo aj ako preprint - arXiv.org: Quantitative Finance. - No. arXiv:0811.0473 [q-fin.ST] (2008), 9 s. -

AFD Publikované príspevky na domácich vedeckých konferenciách

AFD01 Stehlíková, Beáta : Modeling volatility clusters with application to two-factor interest rate models

Lit. 11 zázň., 6 obr.

In: Journal of Electrical Engineering. - Vol. 56, No. 12/s (2005), s. 90-93

[ISCAM 2005 : International Conference in Applied Mathematics for Undergraduate and Graduate Students. Bratislava, 15.-16.4.2005]

AFD02 Stehlíková, Beáta - Ševčovič, Daniel : On a volatility averaging in a two-factor interest rate model

Recenzované

Lit. 11 zázň., 6 obr.

In: Algoritmy 2005. - Bratislava : Slovak University of Technology, 2005. - S. 325-333. - ISBN 80-227-2192-1

[ALGORITMY 2005 : Conference on Scientific Computing. 17th, Vysoké Tatry-Podbanské, 13.-18.3.2005]

Grant VEGA 1/9154/02,

AFD03 Stehlíková, Beáta : Fast mean reverting volatility in Fong-Vasicek model of interest rates

Lit. 5 zázň., 1 obr.

In: Journal of Electrical Engineering. - Vol. 57, No. 12/s (2006), s. 1-5

[ISCAM 2006 : International Conference in Applied Mathematics for Undergraduate and Graduate Students. Bratislava, 7.-8.4.2006]

POZNÁMKA: Vyšlo aj ako abstrakt - ISCAM 2006 Abstracts. - Bratislava : Slovak University of Technology, 2006. - S. 26. -

AFD04 Stehlíková, Beáta : Averaged bond prices in Fong-Vasicek and the generalized Vasicek models of interest rates [elektronický dokument]

Lit. 13 zázň.

In: 15th International Scientific Conference on Mathematical Methods in Economics and Industry : Proceedings (CD ROM). - Košice : UPJŠ, 2007. - S. 166-175. - ISBN 978-80-89089-58-1

[MMEI 2007 : Mathematical Methods in Economics and Industry : International Scientific Conference. 15th, Herľany, 3.-7.6.2007]

POZNÁMKA: Vyšlo aj ako abstrakt - 15th International Scientific Conference on Mathematical Methods in Economics and Industry : Book of Abstracts. - Košice : UPJŠ, 2007. - S. 30-31. - ISBN 978-80-89089-57-4

AFD05 Stehlíková, Beáta 50% - Zíková, Zuzana 50% : A three-factor convergence model of interest rates

Recenzované

Lit. 12 zázň.

In: ALGORITMY 2012. - Bratislava : STU, 2012. - S. 95-104. - ISBN 978-80-227-3742-5

[ALGORITMY 2012 : Conference on Scientific Computing. 19th, Vysoké Tatry-Podbanské, 9.-14.9.2012]

AFG Abstrakty príspevkov zo zahraničných vedeckých konferencií

AFG01 Halgašová, Jana 34% - Stehlíková, Beáta 33% - Zíková, Zuzana 33% : Three-factor convergence model of interest rate

Lit. 3 zázň.

In: ISCAMI 2012. - Ostrava : Universitas Ostraviensis, 2012. - S. 40-41
[ISCAMI 2012 : International Student Conference on Applied Mathematics and Informatics. Malenovice,
10.-13.5.2012]

BDF Odborné práce v ostatných domácich časopisoch

BDF01 Stehlíková, Beáta 100%: Zaujímavý integrál

Lit. 4 záz., 7 obr.

In: Obzory matematiky, fyziky a informatiky. - Roč. 42, č. 1 (2013), s. 19-26

BDF02 Stehlíková, Beáta 50% - Gregušová, Slavomíra 50%: Náhodné stretnutia viacerých ľudí v čase

Lit. 9 záz., 3 obr., 3 tab.

In: Obzory matematiky, fyziky a informatiky. - Roč. 42, č. 3 (2013), s. 19-34

DAI Dizertačné a habilitačné práce

DAI01 Stehlíková, Beáta 100% : Mathematical analysis of term structure models . - Bratislava : [s.n.], 2008. - 108 s.

Lit. 52 záz.

Doktorandská dizertačná práca (PhD.) - Univerzita Komenského, Bratislava, 2008

Štatistika kategórií (Záznamov spolu: 18):

AAA Vedecké monografie vydané v zahraničných vydavateľstvách (1)

AAB Vedecké monografie vydané v domácich vydavateľstvách (1)

ADC Vedecké práce v zahraničných karentovaných časopisoch (4)

ADE Vedecké práce v ostatných zahraničných časopisoch (1)

AFC Publikované príspevky na zahraničných vedeckých konferenciách (2)

AFD Publikované príspevky na domácich vedeckých konferenciách (5)

AFG Abstrakty príspevkov zo zahraničných vedeckých konferencií (1)

BDF Odborné práce v ostatných domácich časopisoch (2)

DAI Dizertačné a habilitačné práce (1)

Štatistika ohlasov (16):

[o1] Citácie v zahraničných publikáciách registrované v citačných indexoch (10)

[o3] Citácie v zahraničných publikáciách neregistrované v citačných indexoch (6)

27.1.2014