



# UNIVERSITÀ DI PISA

## FINANZA MATEMATICA

---

### MAURIZIO PRATELLI

Anno accademico 2019/20  
CdS MATEMATICA  
Codice 110AA  
CFU 6

| Moduli             | Settore/i | Tipo    | Ore | Docente/i         |
|--------------------|-----------|---------|-----|-------------------|
| FINANZA MATEMATICA | MAT/06    | LEZIONI | 42  | MAURIZIO PRATELLI |

#### Obiettivi di apprendimento

##### *Conoscenze*

Fondamenti matematici della moderna Finanza Matematica.

##### *Modalità di verifica delle conoscenze*

Esame finale.

##### *Capacità*

Saper capire e risolvere un problema di valutazione e copertura di prodotti derivati.

##### *Modalità di verifica delle capacità*

Esame finale.

##### *Comportamenti*

Frequentare con attenzione le lezioni.

##### *Modalità di verifica dei comportamenti*

Si ritiene non necessaria.

##### *Prerequisiti (conoscenze iniziali)*

Istituzioni di Analisi e Istituzioni di Probabilità (oltre al corso di Probabilità=

##### *Programma (contenuti dell'insegnamento)*

Valutazione e copertura di opzioni. Modelli per i tassi d'interesse. Misure di rischio.

##### *Bibliografia e materiale didattico*

Appunti scritti dal docente.

##### *Modalità d'esame*

Colloquio orale

Ultimo aggiornamento 28/09/2019 16:45