UNIVERSITÀ DI PISA

FINANZA MATEMATICA

MAURIZIO PRATELLI

Academic year	2016/17
Course	MATEMATICA
Code	110AA
Credits	6

Modules	Area	Type	Hours	Teacher(s)
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 dàinteresse. Misure di rischio.

Bibliografia e materiale didattico
Appunti scritti dal docente.

Modalità d'esame
Colloquio orale

Pagina web del corso
http://people.dm.unipi.it/pratelli/Finanza/finanza.html

Ultimo aggiornamento 09/05/2017 15:25