UNIVERSITÀ DI PISA

FINANZA MATEMATICA

MAURIZIO PRATELLI

Anno accademico	2018/19
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 dàinteresse. Misure di rischio.

Bibliografia e materiale didattico
Appunti scritti dal docente.

Modalità d'esame
Colloquio orale

Ultimo aggiornamento 14/12/2018 17:03