



UNIVERSITÀ DI PISA

FINANZA MATEMATICA

MAURIZIO PRATELLI

Anno accademico	2021/22
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 16/07/2021 16:42