

Metodi Probabilistici per l'Economia

Prof. Ivar Massabò

Corso di Laurea in Metodi Quantitativi per l'Economia e la Gestione delle Aziende

Disciplina	Metodi Probabilistici per l' Economia
Settore Disciplinare	SECS-S/06
Obiettivi Formativi	Fornire gli elementi di base del calcolo delle probabilità sufficienti per affrontare lo studio di fondamentali applicazioni in ambito economico-finanziario
Numero crediti	5
Propedeuticità	Statistica e Calcolo delle Probabilità
Modalità di svolgimento del corso	Lezioni frontali
Modalità di svolgimento dell'esame e valutazione	In forma scritta (redazione di una tesina) ed orale. Trentesimi
Contenuti	<ul style="list-style-type: none">-Variabili aleatorie multiple (cfr. Cap IV, Daboni L.)-Particolari distribuzioni (cfr. Cap V, Daboni L.)-Teoremi limite del calcolo delle probabilità (cfr. Cap VI, Daboni L.)-Processi stocastici discreti a parametro discreto (cfr. Cap VII, Daboni L.)-Catene di Markov (cfr. Cap VIII, Daboni L.)-Il modello binomiale per il prezzamento di opzioni (cfr. Cap 1 e 2, ShreveS.E.)
Bibliografia d'esame	Daboni Luciano; <i>Calcolo delle probabilità ed elementi di statistica.</i> (Capitoli IV, V, VI, VII, VIII) Ovvero qualsiasi altro testo universitario di calcolo delle probabilità Shreve S.E., <i>Stochastic Calculus for Finance 1. Sger Finance Textbook</i> Ovvero qualsiasi altro testo universitario che tratti il metodo binomiale per il prezzamento di opzioni