

# TEORIA DEL RISCHIO DEL MERCATO MOBILIARE

Anno accademico 2007-2008

Docente : Ivar Massabò

Corso di laurea specialistica in Statistica e Informatica per l'Economia e la Finanza

<b>Disciplina</b>	<b>TEORIA DEL RISCHIO DEL MERCATO MOBILIARE</b>
<b>Settore Disciplinare</b>	SESC-S/06
<b>Obiettivi Formativi</b>	L'obiettivo del corso è di fornire agli studenti alcuni degli strumenti analitici maggiormente utilizzati nella moderna finanza matematica per la valutazione e gestione di operazioni finanziarie aleatorie.
<b>Numero crediti</b>	10
<b>Propedeuticità</b>	Statistica, Statistica e Calcolo delle Probabilità, Matematica Attuariale 2
<b>Modalità di svolgimento del corso</b>	Lezioni ed esercitazioni
<b>Modalità di svolgimento dell'esame e valutazione</b>	Presentazione di una tesina, esame orale
<b>Contenuti</b>	Moti browniani. Calcolo stocastico: integrale di Ito, l'equazione di Black-Scholes e Merton. Valutazione di derivati rispetto ad una misura neutrale al rischio. Teorema fondamentale per il calcolo del prezzo di titoli finanziari. Opzioni esotiche. Opzioni di tipo americano. Modelli di strutture a termine.
<b>Bibliografia d'esame</b>	Ludwig Arnold. Stochastic Differential Equations: Theory and Applications. Wiley –Interscience publication. Steven E. Shreve. Stochastic Calculus for Finance II: Continuous-Time Models. Springer Finance textbook (2004)