

MATEMATICA FINANZIARIA

Prof. Marco Micocci

Prerequisiti - Argomenti base dell'analisi matematica, della statistica e della logica economica.

Argomenti ed obiettivi - Il corso affronta gli argomenti introduttivi e basilari della finanza matematica. Ha l'obiettivo di fornire le nozioni di base per la formalizzazione delle operazioni finanziarie, di affrontare i fondamenti logici della valutazione e della scelta finanziaria, di introdurre ai temi specialistici della valutazione finanziaria in condizioni di incertezza e della moderna finanza d'impresa.

Contenuti

Calcolo finanziario tradizionale. I regimi di interesse semplice, composto e iperbolico; le rendite; gli ammortamenti.

La valutazione di operazioni finanziarie in condizioni di certezza. I criteri di scelta: TIR e VAN; la struttura per scadenza dei tassi di interesse; l'arbitraggio; il problema del controllo del rischio di tasso di interesse: duration, convexity e cenni di immunizzazione classica.

La valutazione di operazioni finanziarie in condizioni di incertezza: introduzione. I modelli media - varianza per le scelte di portafoglio; la valutazione delle opzioni finanziarie

Testi di riferimento

CACCIAFESTA F., *Lezioni di Matematica finanziaria classica e moderna*, Torino, Giappichelli *oppure* VOLPE E., *Manuale di Matematica finanziaria*, Napoli, ESI.
MICOCCI M., *Complementi di Matematica finanziaria. Modelli applicativi per la scelta degli investimenti*, Roma, CISU, 1999;
COPPINI S.M., GIORDANO M., MICOCCI M., SPANDONARO F., *Esercitazioni di Matematica finanziaria*, Roma, CISU, 1997.

Pagine Web: <http://web.tiscali.it/miocci> (orari di ricevimento, vecchie prove d'esame, programmi, avvisi, ecc.).