

MODELLI MATEMATICI PER I MERCATI FINANZIARI (MODULO A)

Prof. Marco Micocci

L'esame è finalizzato a presentare in Excel i principali modelli di Finanza matematica ed a introdurre lo studente agli aspetti teorici e computazionali dei modelli stessi. A tale scopo parte delle lezioni si svolgeranno in aula informatizzata. Non sono richieste conoscenze pregresse di elaborazione dati anche se sono, ovviamente, auspicabili.

- Elementi di calcolo delle probabilità
- La struttura a termine dei tassi di interesse; metodi di stima;
- La teoria dell'immunizzazione finanziaria
- La teoria della selezione di portafoglio
- La teoria matematica per la valutazione delle opzioni su titoli azionari, la portfolio insurance e la valutazione di contratti assicurativi equity linked
- Metodi numerici per la Finanza matematica: cenni

Testo d'esame

Micocci M. *Complementi di Matematica Finanziaria. Modelli applicativi per la scelta degli investimenti*; Ed. Cisu; Roma, 1999 (capp. I, II, III e V fino al par. V.6 incluso).

Testo d'esercizi

Micocci M. - Roberti R. *Esercitazioni di Matematica Finanziaria II*; Ed. Cisu; Roma, 1999.

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