

SCHEDA DELL'INSEGNAMENTO DI **PROBABILITA' E PROCESSI STOCASTICI**

Corso di studio FINANZA	Titolo insegnamento in inglese Probability and Stochastic Processes	Laurea/LM/LMcU LM	A.A. 2017/2018
-----------------------------------	---	-----------------------------	-----------------------

Docente: Politano Massimiliano	Tel: 081 675004	email: massimiliano.politano@unina.it
--	---------------------------	---

SSD SECS-S/06	CFU 6	Anno di corso I/II	Semestre II
-------------------------	-----------------	------------------------------	-----------------------

Insegnamenti propedeutici previsti: Metodi Matematici

RISULTATI DI APPRENDIMENTO ATTESI

Conoscenza e capacità di comprensione

Il corso fornisce gli strumenti per interpretare i principali fenomeni aleatori in ambito finanziario; presenta le principali distribuzioni di probabilità; analizza le problematiche dell'equilibrio finanziario, dell'assenza di arbitraggio, delle misure "equivalenti", e dei modelli usati per modellare la dinamica aleatoria sia del mercato azionario che di quello obbligazionario.

Conoscenza e capacità di comprensione applicate

Lo studente dovrà essere in grado di interpretare i principali fenomeni stocastici e le problematiche di equilibrio sia sul mercato azionario che su quello obbligazionario

PROGRAMMA

Probabilità. Variabili casuali. Momenti. Distribuzioni. Teoremi limite. Processi stocastici. Martingale. Moto browniano

CONTENTS

Probability. Random variables. Moments. Probability distribution. Stochastic processes. Martingales. Brownian motion.

MATERIALE DIDATTICO

- Sheldon Ross. Calcolo delle probabilità. Apogeo editore
- Nolfe - Buonocore. Lezioni di processi stocastici. Edizioni scientifiche italiane.

FINALITA' E MODALITA' PER LA VERIFICA DI APPRENDIMENTO

a) Risultati di apprendimento che si intende verificare:

L'esame verifica le conoscenze apprese e le competenze acquisite risolvendo i casi proposti.

b) Modalità di esame:

L'esame si articola in una prova orale

In caso di prova scritta, i quesiti sono*:

(*) possibili più risposte

☐ A risposta multipla

☐ A risposta libera

☐ Esercizi numerici