SCHEDA DELL'INSEGNAMENTO DI MATEMATICA FINANZIARIA

Corso di studio Economia delle Imprese Finanziarie
Titolo insegnamento in inglese Financial Mathematics
Laurea/LM/LMcu Laurea
A.A. 2017/2018

Docente: Emilia Di Lorenzo
Tel.: 081-675102
email: emilia.dilorenzo@unina.it

SSD SECS/S-06
CFU 10
Anno di corso II
Semestre I

Insegnamenti propedeutici previsti:

RISULTATI DI APPRENDIMENTO ATTESI

Conoscenza e capacità di comprensione

Il corso fornisce la modellistica quantitativa per le applicazioni finanziarie, con particolare riguardo alla scelta fra operazioni finanziarie, alla gestione dei rischi di tasso di interesse, ai contratti derivati.

Conoscenza e capacità di comprensione applicate

Lo studente dovrà essere in grado di applicare la modellistica quantitativa ai fini del pricing e della misura dei rischi di contratti finanziari.

PROGRAMMA

La base matematica delle operazioni finanziarie, la struttura a termine dei tassi di interesse, ammortamenti, scelte finanziarie, strategie di immunizzazione, indici di volatilità obbligazionari, piani a tasso variabile, forward, futures, elementi di probabilità per le decisioni in condizioni di incertezza.

CONTENTS

Mathematical bases of the financial calculus, the interest rate term structure, repayment of a debt, financial choices, immunization portfolio strategy, bond volatility measures, indexed financial contracts, forward, futures, probability based models for choices under uncertainty.

MATERIALE DIDATTICO

M. D'Amico, E. Luciano, L. Peccati, Calcolo finanziario. Temi di base e temi moderni, Egea, Milano, 2011
D. G. Luenberger: Finanza e investimenti. Fondamenti matematici, APOGEO, Milano 2006 di G. Castellani, M. De Felice, F. Moriconi, Manuale di Finanza, **Vol. I, II, III**, Il Mulino, 2006
E. Castagnoli e L. Peccati, Matematica in azienda 1. Calcolo finanziario con applicazioni, Egea, Milano (2002).
M. D'Amico, E. Moretto, Matematica finanziaria. Esercizi, Egea, Milano (2002).

FINALITA' E MODALITA' PER LA VERIFICA DI APPRENDIMENTO

a) Risultati di apprendimento che si intende verificare:

L'esame verifica le conoscenze apprese e la capacità di applicare le competenze acquisite risolvendo gli esercizi proposti.

b) Modalità di esame:

L'esame si articola in prova: Scritta e orale Solo scritta Solo orale

Discussione di elaborato progettuale:

Altro (specificare):

In caso di prova scritta, i quesiti sono*: A risposta multipla A risposta libera Esercizi numerici
(* possibili più risposte)