**Scheda insegnamento**

**Modulo di “Matematica finanziaria” / “Mathematical finance”**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
|  | **Italiano** | **English** |
| **Docente/Instructor** | Gianna Figà-Talamanca | Gianna Figà-Talamanca |
| **Titolo/Title** | Matematica finanziaria | Mathematical finance |
| **Contenuti/Contents** | Valutazione di titoli derivati. Misurazione e gestione del rischio di mercato Modelli per la volatilità dei mercati finanziari. | Derivative pricing. Market risk measures and management . Volatility modelling. |
| **Metodologia/Method** | * Analisi teorica * Discussione di papers * Discussioni in classe o realizzazione lavori individuali | * Theoretical analysis * Discussion of scientific papers * In class discussion or individual assignments |
| **N. Ore/ N. hours** | **18** | **18** |
| **Mese/Month\*** | **Novembre/Dicembre** | **November/December** |
| **Curriculum** | - QME | - QME |
| **Testi di riferimento/ Suggested readings** | Opzioni, Futures e altri Derivati, J. Hull, Ed. Pearson, Prentice-Hall.  Arbitrage Theory in Continuous Time, T. Björk, Ed. Oxford university press.  Quantitative Risk Management, P. Embrechts, R. Frey, A. McNeil, Ed. Princeton University Press  Dispense e articoli scientifici saranno eventualmente forniti dal Docente. | Options, Futures and Other Derivatives, Ed. Pearson, Prentice-Hall.  Arbitrage Theory in Continuous Time, T. Björk, Ed. Oxford university press.  Quantitative Risk Management, P. Embrechts, R. Frey, A. McNeil, Ed. Princeton University Press  Notes and original scientific articles will be possibly provided by the Instructor. |

\* For details, please, refer to the calendar available at <http://dottorato.ec.unipg.it/it/>