

	Italiano	English
Docente/Instructor	Gianna Figà-Talamanca	Gianna Figà-Talamanca
Titolo/Title	FINANZA MATEMATICA	MARHEMATICAL FINANCE
Contenuti/Contents (18 ORE / 18 HOURS)	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.
Testi/Reading list	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.
Mese/Month*:		