

# **Mf1- Modelli Matematici per Mercati Finanziari**

## **Programma**

Nozioni base della matematica finanziaria. I derivati e loro valutazione. Dinamiche di prezzo, a tempo discreto e continuo: il modello di Cox, Ross, Rubinstein e la formula di Black, Scholes. Problemi di gestione del rischio finanziario. I mercati dei tassi d'interesse. Valutazione di obbligazioni e modelli di struttura a termine dei tassi.

## **Materiale Didattico**

1] Hull, John, Opzioni, Futures ed altri derivati. Sole 24 Ore, (2000).