

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

## **Programma**

Nozioni base di matematica finanziaria. Valutazione delle attività finanziarie e dei titoli obbligazionari. Struttura a termine dei tassi d'interesse. Richiami di nozioni di base di calcolo delle probabilità. Modelli CAPM ed APT per le scelte di portafoglio. Funzioni di utilità. Nozioni di base di calcolo stocastico. Dinamiche di prezzo dei titoli azionari a tempo discreto e continuo. Valutazione dei derivati: il modello di Cox Ross, Rubinstein; il modello di Black & Scholes.

## **Materiale Didattico**

[1] Luenberger, David G.: Finanza e investimenti. Fondamenti matematici. Apogeo (2006). [2] Hull, John, Opzioni, Futures ed altri derivati. Sole 24 Ore, (2000). [3] Note del docente

---