



Università degli Studi di
Milano-Bicocca

Master in Finance and Risk Management
FINARM

Anno Accademico 2001/2002

Corso di Valutazione dei Derivati

Programma sintetico del corso

Principali derivati, utilizzo e finalità (copertura, arbitraggio e speculazione)

Modelli Uniperiodali – Sharpe, Rendleman e Bartter

Teoremi fondamentali dell'Asset Pricing

Valutazioni risk-neutral

Modelli multi-periodali – Cox, Ross, Rubinstein

Metodi di replicazione di portafoglio

Metodi di Martingala

Processi stocastici dei mercati finanziari

Moto Browniano e equazioni differenziali stocastiche

Il modello di Black, Scholes, Merton

Metodo di replicazione di portafoglio

Metodo di Martingala

Metodo delle equazioni differenziali parziali