

SCHEDA DELL' INSEGNAMENTO DI FINANZA MATEMATICA I

MATHEMATICAL FINANCE

Corso di Laurea di ECONOMIA AZIENDALE

Insegnamento di
FINANZA MATEMATICA

MAGISTRALE A.A. 2017/2018

Docente: Giovanna Di Lorenzo

☎081675332

email:giovanna.dilorenzo@unina.it

SSD

CFU

Anno di corso (I, II o III)

Semestre (I o II)

Insegnamenti propedeutici previsti: _____

RISULTATI DI APPRENDIMENTO ATTESI

Conoscenza e capacità di comprensione (max 4 righe, Times New Roman 10)
Lo studente deve apprendere modelli della matematica inerenti alle decisioni finanziarie in condizioni di incertezza, con particolare riferimento ai mercati azionari, all'acquisizione di metodologie di selezione del portafoglio, di modellistica attinente aspettative e rischio nei mercati, nonché della struttura e della valutazione di contratti derivati.
Conoscenza e capacità di comprensione applicate (max 4 righe, Times New Roman 10)
Lo studente deve essere in grado di formalizzare e valutare problematiche all'economia finanziaria applicando in maniera opportuna le conoscenze acquisite.
Eventuali ulteriori risultati di apprendimento attesi, relativamente a:
Autonomia di giudizio: Lo studente deve essere in grado di valutare i fenomeni finanziari effettuando una opportuna selezione dei modelli quantitativi
Abilità comunicative: lo studente deve essere in grado di illustrare in maniera rigorosa il ruolo delle tecniche di scelta nell'ambito dell'incertezza, gestione del rischio attraverso la diversificazione, i modelli di determinazione del prezzo e di misurazione del rischio
Capacità di apprendimento: lo studente deve dimostrare capacità di approfondimento delle tematiche sviluppate nel corso in maniera autonoma e con il contributo del docente.

PROGRAMMA (in italiano, min 10, max 15 righe, Times New Roman 10, raggruppando i contenuti al massimo in 10 argomenti)

Teoria delle decisioni finanziarie in condizioni di incertezza: formalizzazione del problema di scelta. La teoria dell'utilità attesa. Analisi media-varianza: analisi rischio-rendimento per la selezione di portafoglio. Capital Asset Pricing Model. Arbitrage Pricing Theory: Contratti derivati: opzioni finanziarie Il valore a rischio (VaR)
--

CONTENTS (in English, min 10, max 15 lines, Times New Roman 10,)

Decisions Under Uncertainty : The choice problem formalization. Expected Utility Theory Mean-variance analysis: Risk-Performance Analysis for Portfolio Selection Capital Asset Pricing Model Arbitrage Pricing Theory Financial Options Value at risk (VaR)

MATERIALE DIDATTICO (max 4 righe, Times New Roman 10)

Ai fini del superamento dell'esame sono consigliati I seguenti testi: G. Castellani, M. De Felice, F. Moriconi, Manuale di Finanza, Vol. II e III Ed Il Mulino u.e. E. Rosazza Gianin, Esercizi di finanza matematica Springer ed P. Wilmott, Introduzione alla finanza quantitative ed Egea u.e.
--

SCHEDA DELL' INSEGNAMENTO DI FINANZA MATEMATICA I
MATHEMATICAL FINANCE

Corso di Laurea di ECONOMIA AZIENDALE

Insegnamento di
FINANZA MATEMATICA

MAGISTRALE A.A. 2017/2018

MODALITA' DI ESAME

L'esame si articola in prova	Scritta e orale	
Discussione di elaborato progettuale		X
Altro, specificare		

Solo scritta	

Solo orale	

In caso di prova scritta i quesiti sono (*)	A risposta multipla	
--	----------------------------	--

A risposta libera	X
--------------------------	----------

Esercizi numerici	X
--------------------------	----------

(*) E' possibile rispondere a più opzioni