

Finanza matematica

Prof. Tiziano Vargiolu¹

¹ *Università di Padova*
Dipartimento di Matematica Pura ed Applicata
Email: vargiolu@math.unipd.it

Calendario: 10 ore, Mercoledì e Giovedì ore 14.30 - 16.30. Prima lezione 15 settembre 2010.
Torre Archimede.

Prerequisiti: ??.

Tipologia di esame: Orale.

SSD: MAT/06

Programma:

Il modello e la formula di Black-Scholes. Equazione di Kolmogorov e formula di Feynman-Kac. Misure di martingala equivalenti: cambio di probabilità e cambio di numeraire, primo e secondo teorema fondamentale del prezzaggio di titoli. Altre applicazioni: opzioni di scambio, opzioni con tasso stocastico.