

Finanza matematica

Prof. Tiziano Vargiolu¹

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

Calendario: 10 ore (2 ore al giorno dalle 14.30 alle 16.30), Torre Archimede, svolte nei giorni:

20, 21 ottobre

27, 28 ottobre

3 novembre

aula 2BC/30

Prerequisiti: I contenuti del corso del Prof. Guiotto *Introduzione ai processi di diffusione*.

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. Altre applicazioni: opzioni di scambio, opzioni con tasso stocastico.