

Finanza matematica

Prof. Tiziano Vargiolu¹

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

Calendario: 10 ore, 16, 17, 23, 24, 30 settembre 2009, ore 14.30-16.30.

Prerequisiti: I contenuti del corso del Prof. Guiotto *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, primo e secondo teorema fondamentale del prezzaggio di titoli. Altre applicazioni: opzioni di scambio, opzioni con tasso stocastico.