

Introduzione Alla Finanza Matematica

[DOWNLOAD HERE](#)

Il libro illustra l'approccio della moderna finanza matematica al caso dei titoli derivati, certamente gli strumenti pi innovativi e pi diffusi del mercato finanziario. La metodologia detta di non arbitraggio (o di Black e Scholes) viene illustrata sia in termini euristici sia in termini formali e applicata per fornire la guida al pricing e all'hedging dei titoli c.d. derivati in quanto dipendenti da altri titoli: forward e futures, floaters, swap, opzioni sia semplici sia esotiche, titoli strutturati e opzioni nascoste, di mercato azionario, di tasso d'interesse, di cambio, di credito etc. I derivati sono analizzati sia per le finalit speculative sia per quelle di copertura dei rischi. Grafici, esempi numerici, riferimenti normativi (Consob) ed esercizi aiutano il lettore alla comprensione dei diversi strumenti considerati. I modelli teorici tra i pi noti in letteratura sono presi in esame, analizzati passo per passo e messi a confronto. Il libro illustra l'approccio della moderna finanza matematica al caso dei titoli derivati, certamente gli strumenti pi innovativi e pi diffusi del mercato finanziario. La metodologia detta di non arbitraggio (o di Black e Scholes) viene illustrata sia in termini euristici sia in termini formali e applicata per fornire la guida al pricing e all'hedging dei titoli c.d. derivati in quanto dipendenti da altri titoli: forward e futures, floaters, swap, opzioni sia semplici sia esotiche, titoli strutturati e opzioni nascoste, di mercato azionario, di tasso d'interesse, di cambio, di credito etc. I derivati sono analizzati sia per le finalit speculative sia per quelle di copertura dei rischi. Grafici, esempi numerici, riferimenti normativi (Consob) ed esercizi aiutano il lettore alla comprensione dei diversi strumenti considerati. I modelli teorici tra i pi noti in letteratura sono presi in esame, analizzati passo per passo e messi a confronto. La trattazione si presta a un doppio livello di lettura: un livello semplice e introduttivo, che richiede solo nozioni matematiche di base e punta alla comprensione pratica dei concetti e degli strumenti e un livello pi avanzato che utilizza il calcolo stocastico e alcuni risultati fondamentali della probabilit, della matematica e della statistica. Il primo livello pensato per gli insegnamenti universitari della laurea triennale mentre il secondo livello si rivolge ai corsi di laurea magistrale e specialistica, di master e dottorato. Un'appendice sui risultati pi avanzati, sui processi stocastici, le procedure numeriche e la simulazione Monte Carlo rendono il testo relativamente autosufficiente. Il libro illustra l'approccio della moderna finanza matematica al caso dei titoli derivati, certamente gli strumenti pi innovativi e pi diffusi del

mercato finanziario. La metodologia detta di non arbitraggio (o di Black e Scholes) viene illustrata sia in termini euristici sia in termini formali e applicata per fornire la guida al pricing e all'hedging dei titoli c.d. derivati in quanto dipendenti da altri titoli: forward e futures, floaters, swap, opzioni sia semplici sia esotiche, titoli strutturati e opzioni nascoste, di mercato azionario, di tasso d'interesse, di cambio, di credito etc.. I derivati sono analizzati sia per le finalità speculative sia per quelle di copertura dei rischi. Grafici, esempi numerici, riferimenti normativi (Consob) ed esercizi aiutano il lettore alla comprensione dei diversi strumenti considerati. I modelli teorici tra i più noti in letteratura sono presi in esame, analizzati passo per passo e messi a confronto. La trattazione si presta a un doppio livello di lettura: un livello semplice e introduttivo, che richiede solo nozioni matematiche di base e punta alla comprensione pratica dei concetti e degli strumenti e un livello più avanzato che utilizza il calcolo stocastico e alcuni risultati fondamentali della probabilità, della matematica e della statistica. Il primo livello pensato per gli insegnamenti universitari della laurea triennale mentre il secondo livello si rivolge ai corsi di laurea magistrale e specialistica, di master e dottorato. Un'appendice sui risultati più avanzati, sui processi stocastici, le procedure numeriche e la simulazione Monte Carlo rendono il testo relativamente autosufficiente. EAN/ISBN : 9788847008205 Publisher(s): Springer, Berlin, Springer, Milan Format: ePub/PDF Author(s): Cesari, Riccardo

[DOWNLOAD HERE](#)

Similar manuals:

[Introduzione Alla Finanza Matematica](#)