



Università degli Studi di
Milano-Bicocca

Master in Finance and Risk Management
FINARM

Anno Accademico 2006/2007

Corso di Gestione del Portafoglio Derivati

Programma sintetico del corso

Calcolo stocastico applicato alla finanza

PDE e SDE utilizzate in finanza

Derivati lineari e convessi

Pricing attraverso Metodi di Martingala e di Replicazione di portafoglio

Static e Dynamic Hedging

Approcci varianza-covarianza

Misure di rischio assolute e condizionali

Strategie di arbitraggio dei rischi di mercato e di credito

Ingegneria finanziaria e finanza strutturata

Strategie di gestione di portafoglio in presenza di derivati: distribuzione di probabilità dei rendimenti, misure di rischio e timing dell'investimento

Risk-limits e risk-management di portafogli in presenza di derivati