



Università degli Studi di  
**Milano-Bicocca**

**Master in Finance and Risk Management**  
**FINARM**

**Anno Accademico 2004/2005**

***Corso di Modelli Matematici per la Finanza***

Programma sintetico del corso

Equazioni differenziali parziale e stocastiche in Finanza

Approcci varianza-covarianza

Misure di rischio assolute e condizionali

Modellizzazione dei rischi sui mercati finanziari

Teorema fondamentale dell'Asset Pricing

Strategie di arbitraggio dei rischi di mercato e di credito

Distribuzione di probabilità dei rendimenti di uno strumento finanziario

Misure di volatilità quali proxy del rischio di uno strumento finanziario

Timing dell'investimento e probabilità dei tempi di primo passaggio