

Argomenti svolti/da svolgere di Matematica finanziaria e corrispondenze sui testi

a.a. 2013/14

Trattandosi di una traccia ex ante le settimane possono subire variazioni di numero e/o contenuti.

Settimana 1 e 2

Matematica finanziaria in condizioni di certezza

Argomento: Regimi finanziari

Riferimenti ai testi

TEORIA

Libro di teoria “[Manuale di Matematica finanziaria. Metodi e strumenti quantitativi per il risk management](#)” Marco Micocci, Giovanni Batista Masala, Editore CAROCCI, 2012 .

Parte I – Capitolo 1 – Paragrafi da 1 a 8

ESERCIZI

Libro di esercizi “[Esercitazioni di Matematica finanziaria.](#)” Sergio Coppini e altri, Editore CISU, 2006.

Parte I – Capitoli 1 e 2 (da pag. 3 a pag. 15)

Parte II – Capitoli 1 e 2 (da pag. 39 a 139)

Settimana 3

Argomento: Rendite

Riferimenti ai testi

TEORIA

Libro di teoria "[Manuale di Matematica finanziaria. Metodi e strumenti quantitativi per il risk management](#)" Marco Micocci, Giovanni Batista Masala, Editore CAROCCI, 2012 .

Parte I – Capitolo 2 – Paragrafi da 1 a 3

ESERCIZI

Libro di esercizi "[Esercitazioni di Matematica finanziaria.](#)" Sergio Coppini e altri, Editore CISU, 2006.

Parte I – Capitolo 3 (da pag. 15 a pag. 25)

Parte II – Capitolo 2 (da pag. 97 a 139)

Settimana 4

Argomento: Teoria degli ammortamenti

Riferimenti ai testi

TEORIA

Libro di teoria "[Manuale di Matematica finanziaria. Metodi e strumenti quantitativi per il risk management](#)" Marco Micocci, Giovanni Batista Masala, Editore CAROCCI, 2012 .

Parte I – Capitolo 3 – Paragrafi da 1 a 8

ESERCIZI

Libro di esercizi "[Esercitazioni di Matematica finanziaria.](#)" Sergio Coppini e altri, Editore CISU, 2006.

Parte I – Capitolo 4 (da pag. 25 a pag. 29)

Parte II – Capitolo 3 (da pag. 140 a 229)

Settimana 5

Argomento: TIR, Van Operazioni e tassi a pronti e termine

Riferimenti ai testi

TEORIA

Libro di teoria "[Manuale di Matematica finanziaria. Metodi e strumenti quantitativi per il risk management](#)" Marco Micocci, Giovanni Batista Masala, Editore CAROCCI, 2012 .

Parte I – Capitolo 4 – Paragrafi da 1 a 2

Parte I – Capitolo 5 – Paragrafi da 1 a 5

ESERCIZI

Libro di esercizi "[Esercitazioni di Matematica finanziaria.](#)" Sergio Coppini e altri, Editore CISU, 2006.

Parte I – Capitolo 5 (da pag. 29 a pag. 38)

Parte II – Capitolo 5 (da pag. 247 a 308)

Parte III – Capitolo 1 (da pag. 309 a 392)

Settimana 6

Argomento: Duration e introduzione all'immunizzazione finanziaria

Riferimenti ai testi

TEORIA

Libro di teoria "[Manuale di Matematica finanziaria. Metodi e strumenti quantitativi per il risk management](#)" Marco Micocci, Giovanni Batista Masala, Editore CAROCCI, 2012 .

Parte II – Capitolo 6

ESERCIZI

Libro di esercizi "[Esercitazioni di Matematica finanziaria.](#)" Sergio Coppini e altri, Editore CISU, 2006.

Parte III – Capitolo 1 (da pag. 309 a 392)

Settimana 7

Argomento: La teoria dell'immunizzazione finanziaria; il caso di una o più uscite, l'immunizzazione a minimo prezzo e a massima duration di II ordine

Riferimenti ai testi

TEORIA

Libro di teoria “[Manuale di Matematica finanziaria. Metodi e strumenti quantitativi per il risk management](#)” Marco Micocci, Giovanni Batista Masala, Editore CAROCCI, 2012 .

Parte II – Capitolo 6

ESERCIZI

Libro di esercizi “[Esercitazioni di Matematica finanziaria.](#)” Sergio Coppini e altri, Editore CISU, 2006.

Parte III – Capitolo 1 (da pag. 309 a 392)

Settimana 8

Argomento: Opzioni finanziarie e modello CRR; interest rate swap

Riferimenti ai testi

TEORIA

Libro di teoria “[Manuale di Matematica finanziaria. Metodi e strumenti quantitativi per il risk management](#)” Marco Micocci, Giovanni Batista Masala, Editore CAROCCI, 2012 .

Parte II – Capitolo 11 – paragrafi 1 e 2

ESERCIZI

Libro di esercizi “[Esercitazioni di Matematica finanziaria.](#)” Sergio Coppini e altri, Editore CISU, 2006.

Parte III – Capitolo 2 (da pag. 392 a 396)

Settimana 9

Argomento: Opzioni finanziarie e modello CRR; interest rate swap

Riferimenti ai testi

TEORIA

Libro di teoria “[Manuale di Matematica finanziaria. Metodi e strumenti quantitativi per il risk management](#)” Marco Micocci, Giovanni Batista Masala, Editore CAROCCI, 2012 .

Parte II – Capitolo 11 – paragrafi 1 e 2

ESERCIZI

Libro di esercizi “[Esercitazioni di Matematica finanziaria.](#)” Sergio Coppini e altri, Editore CISU, 2006.

Parte III – Capitolo 2 (da pag. 392 a 396)

Dispense su IRS da scaricare da www.econoca.it