

MATEMATICA FINANZIARIA
disciplina prevista nel Precedente Ordinamento (PO) e nel Nuovo Ordinamento (NO)
Maria Rosaria Simonelli
(Istituto di Statistica e Matematica)

I modulo - 3 CFU (corsi di laurea NO: AC, EA, EC, EOIC, IM, LT, RTBC e corsi di laurea quadriennale del PO, propedeutico al II modulo di 3 CFU che è parte integrante del corso di 6 CFU del corso di laurea NO: AC e del corso di 9 CFU dei corsi di laurea quadriennale del PO)

La relazione fondamentale della matematica finanziaria. Le progressioni (aritmetiche e geometriche) e le rendite. Ammortamenti. I criteri del risultato economico attualizzato (REA) e del tasso interno di rendimento (TIR).

Testi consigliati:

- SIMONELLI, Appunti di matematica finanziaria classica.
- STEFANI, TORRIERO, ZAMBRUNO, Elementi di matematica finanziaria e cenni di programmazione lineare, Giappichelli, u.e.

Per gli esercizi:

- SIMONELLI, Esercizi di matematica finanziaria classica.

II modulo - 3 CFU (parte integrante del corso di 6 CFU del corso di laurea del NO: AC e del corso di 9 CFU dei corsi di laurea quadriennale PO, propedeutico al III modulo di 3 CFU, che è parte integrante del corso di 9 CFU dei corsi di laurea quadriennale del PO)

Spazi di probabilità discreti e continui per schemi finanziari decisionali. Valori medi. Varianza di portafoglio. Il criterio media-varianza. La selezione di portafoglio. La teoria dell'utilità.

Testi consigliati:

- SIMONELLI, Primi elementi di probabilità in finanza, Liguori, u.e.
- SIMONELLI, La selezione di portafoglio, la teoria dell'utilità (in corso di stampa)

Per gli esercizi:

- SIMONELLI, Esercizi su selezione di portafoglio e teoria dell'utilità (in corso di stampa)

III modulo - 3 CFU (parte integrante del corso di 9 CFU dei corsi di laurea quadriennale del PO)

I futures e le options.

Testi consigliati:

- SIMONELLI, I futures, le options (in corso di stampa)

Per gli esercizi:

- SIMONELLI, Esercizi su futures, options (in corso di stampa)

NB !

Gli studenti che intendono sostenere l'esame a **novembre 2001** possono preparare il programma del **I modulo** sui testi consigliati:

- BASSO, PIANCA, Appunti di matematica finanziaria, IV ed., Padova, Cedam, 1999 (pp. 1-99)
- SIMONELLI, Esercizi di matematica finanziaria classica (pp. 125-190)