baratz | ODA

Introduzione alla finanza matematica /

Cesari, Riccardo

Springer,
2009

Monografía

Il libro illustra l'approccio della moderna finanza matematica al caso dei titoli derivati, certamente gli strumenti più innovativi e più 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 è 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

https://rebiunoda.pro.baratznet.cloud:28443/OpacDiscovery/public/catalog/detail/b2FpOmNlbGVicmF0aW9uOmVzLmJhcmF0ei5yZW4vMzYyMzczMzY

Título: Introduzione alla finanza matematica Riccardo Cesari

Edición: 1st ed. 2009

Editorial: Milano Springer 2009

Descripción física: 1 online resource (472 p.)

Mención de serie: Unitext / La Matematica Per Il 3+2

Nota general: Description based upon print version of record

Bibliografía: Includes bibliographical references and index

Contenido: Derivati e mercati -- La struttura per scadenza dei tassi d'interesse e i fondamenti del pricing di non arbitraggio -- Forward -- Futures -- Floaters -- Swaps -- Opzioni plain vanilla -- Opzioni e modelli non standard -- Opzioni su tassi d'interesse -- Opzioni esotiche -- Opzioni nascoste e titoli strutturati: garanzie, clausole, opportunità -- Procedure numeriche

Lengua: Italian

ISBN: 1-283-25142-6 9786613251428 88-470-0820-4

Materia: Finance- Mathematical models Investments- Mathematics Derivative securities- Prices- Mathematical models

Enlace a formato físico adicional: 88-470-0819-0

Punto acceso adicional serie-Título: Unitext / La Matematica Per Il 3+2

Baratz Innovación Documental

- Gran Vía, 59 28013 Madrid
- (+34) 91 456 03 60
- informa@baratz.es