

<ul style="list-style-type: none">4.1. Derivati americani indipendenti dal percorso4.2. Tempi d'arresto4.3. Derivati americani generali4.4. Call options americane5. Random walk<ul style="list-style-type: none">5.1. Tempi di primo passaggio5.2. Principio di riflessione5.3. Put options americane perpetue6. Valori dipendenti dai tassi di interesse<ul style="list-style-type: none">6.1. Modello binomiale per i tassi di interesse6.2. Derivati a reddito fisso6.3. Misure forward6.4. Futures
Metodi di insegnamento: Lezioni ed esercitazioni in aula
Supporti alla didattica: Note, articoli e appunti di complemento disponibili sulla pagina web http://www.ba.infn.it/~cufaro/didactic.html
Controllo dell'apprendimento e modalità d'esame: Prova orale
Testi di riferimento principali: S.E. Shreve: Stochastic Calculus for Finance I – The binomial asset pricing model (Springer 2004)