

SCHEDA INFORMATIVA DEL CORSO ESTIVO PROPOSTO A BRESSANONE - 2024

Ciascun docente proponente dovrà compilare la scheda informativa che verrà pubblicata nel sito dedicato: <http://www.unipd.it/corsi-estivi-bressanone>, in modo tale da permettere allo studente di iscriversi consapevolmente.

TITOLO DEL CORSO (attività formativa istituzionale erogata):	-STOCHASTIC METHODS FOR FINANCE [INP5070417]
DOCENTE che tiene il corso a Bressanone + Docente sostituto	- Martino Grasselli - Giorgia Callegaro
A CHI È RIVOLTO IL CORSO (inserire <u>tutti i corsi di laurea</u> per cui l'attività formativa verrà riconosciuta)	Studenti iscritti al Corso di laurea magistrale a ciclo unico in: - Mathematical Engineering - Mathematics - Data Science - Statistics - Physics of Data -
CFU (coincidono con i CFU complessivi dell'esame che verrà registrato in uniweb)	- Mathematical Engineering (9) - Mathematics (7) - Data Science (6) - Statistics (6) - Physics of Data (6)
PROGRAMMA DEL CORSO Argomenti che si intendono approfondire a Bressanone	The course presents some important models that are typically used in the banking industry (including Black-Scholes, Heston, Vasicek). Students at the end should be familiar with pricing and hedging in both discrete and continuous time and should be able to apply stochastic methods to the pricing of equity/forex/fixed income products.- -
BIBLIOGRAFICA (i testi indicati verranno messi a disposizione, se reperibili, nella Biblioteca della Casa della Gioventù, con l'aiuto del CAB)	- Bjork Thomas, Arbitrage theory in continuous time. Oxford Univ. Press, 2004. - Lamberton D. and Lapeyre, B., Introduction to stochastic calculus applied to finance. Cambridge Univ. Press, 2000. - Lecture notes and additional material provided by the teacher -
PREFERENZA ORARIO GIORNALIERO Inserire la fascia orario di preferenza, <u>l'ufficio si riserva comunque la possibilità di modificare gli orari in caso di sovrapposizioni di corsi della stessa area, previa comunicazione.</u> Non saranno ammessi cambi di orario in loco improvvisati, per non creare disagi.	Da lunedì a venerdì (I e II settimana) h: 10:30-12:30
MODALITA' DI ACCERTAMENTO FINALE <u>Per una attività formativa erogata in più canali le modalità di riconoscimento dell'esame dovranno essere le medesime.</u> L'esame (parziale o dell'intera attività formativa) è previsto l'ultimo giorno di corso, venerdì o sabato.	L'accertamento si svolge con la seguente modalità: Presentazione e discussione di un progetto svolto durante le due settimane di Bressanone
INDICAZIONI SULLA REGISTRAZIONE FINALE	Il voto verrà comunicato entro il 15 agosto

La verbalizzazione su Uniwed si effettua nelle date previste dalla sessione d'esame di recupero. Pertanto i CFU registrati su attività formative sostenute a Bressanone non concorrono per l'ottenimento della borsa di studio, con verifica al 10 agosto.

(indicare il periodo e la modalità di comunicazione)

Il risultato della prova verrà comunicato entro il 15 agosto e verrà verbalizzato in corrispondenza dell'appello di settembre

L'esame verrà registrato dal docente titolare:

- direttamente iscrivendosi all'appello di settembre