

SYLLABUS DEL CORSO

Interest Rate Derivatives

2122-2-F1601M064-F1601M075M

Obiettivi formativi

Contenuti sintetici

Il corso introduce alla valutazione _____

- *FRA, Futures, e Swaps*
- *Bootstrapping* delle curve di tasso in scenari multi-curva
- Modello di Black e varianti *shifted log-normal*
- Volatilità dei tassi di interesse: *par, forward, no-arbitrage* e modello SABR
- Modelli di struttura a termine: equilibrio, non-arbitraggio, *short rate* e modelli di mercato
- *Cap, Floor, Swaption* e *Swaption* Bermudane
- *Credit Default Swaps*
- *Bootstrapping* delle curve di credito
- Rischio di controparte: *clearing*, collateralizzazione e correzioni di valutazione XVA
- Gestione del rischio di mercato: greche e replica statica di prodotti strutturati

Programma esteso

Periodo di erogazione dell'insegnamento

Primo semestre, ottobre-gennaio

Lingua di insegnamento

Il materiale didattico è in inglese, la lezione in italiano.
