



UNIVERSITÀ
DEGLI STUDI DI MILANO-BICOCCA

SYLLABUS DEL CORSO

Matematica Finanziaria - 2

2122-2-E1802M118-E1802M021M-T2

Obiettivi formativi

Obiettivo generale del corso è illustrare i principi e concetti di base della Matematica Finanziaria classica e le loro applicazioni al calcolo finanziario e ai problemi di scelta basati sui flussi di cassa.

Contenuti sintetici

Operazioni finanziarie. Leggi di capitalizzazione. Rendite.
Costituzione di un capitale. Ammortamenti. Criteri di scelta. Titoli obbligazionari.
Regimi finanziari di capitalizzazione e di attualizzazione. Regime a interesse semplice, a interesse anticipato e a interesse composto. Tassi equivalenti e convertibili. La forza d'interesse. Condizione di scindibilit a. Rendite: definizione, classificazione e valutazione.
Costituzione di un capitale. Ammortamento di prestiti indivisi, ammortamento americano, ammortamento italiano, ammortamento francese. Criteri di scelta tra operazioni finanziarie: il criterio del tempo di recupero, del R.E.A., del T.I.R. Generalit a sui titoli obbligazionari. Indicatori di redditivit a dei titoli obbligazionari. Tassi spot. Tassi forward. La struttura a termine dei tassi d'interesse. Duration, convessit a e cenni di immunizzazione.

Programma esteso

Prerequisiti

Metodi Quantitativi I

Metodi didattici

Lezione frontale in aula e svolgimento di esercizi nelle ore di esercitazione. Le lezioni ed esercitazioni si svolgeranno in presenza nelle aule indicate ma sarà sempre garantito il collegamento streaming per studenti che seguono da casa.

Modalità di verifica dell'apprendimento

Si rimanda al documento Modalità d'esame per tutti i dettagli e alle slide pubblicate la prima lezione del corso.

Testi di riferimento

S. Stefani, A. Torriero, G.M. Zambruno
Elementi di Matematica finanziaria e cenni di programmazione lineare
Giappichelli, Torino, 2017
Quinta Edizione
e
G. Bolamperti, G. Ceccarossi
Elementi di Matematica finanziaria e cenni di programmazione lineare - Esercizi

Periodo di erogazione dell'insegnamento

I semestre (2 novembre 2021- 12 gennaio 2022)

Lingua di insegnamento

Italiano
