UNIVERSITÀ
DEGLI STUDI DI MILANO-BICOCCA

COURSE SYLLABUS

Dynamic Asset Pricing

2324-1-F1601M054-F1601M059M

Obiettivi

Obiettivi formativi
Al termine del corso lo studente sarà familiare con i principali concetti e modelli di asset pricing

Contenuti sintetici

Modelli di Asset Pricing tradizionali
Valutazione del Rischio
Titoli a reddito fisso
Asset Pricing in Equilibrio Generale

Programma esteso

Math preliminaries and general equilibrium
Overview of Pricing Theories
Choices under risk
Measures of risk aversion and their interpretation
Risk Aversion and Investment Choices
Modern Portfolio Theory
Capital Asset Pricing Model
Arrow-Debreu Equilibrium and the CAPM
CCAPM
Arrow-Debreau Pricing: Arbitrage
Martingale Pricing

Term Structure of Interest Rates
APT and Multifactor Models

Prerequisiti

Maths
Statistics
Inference
Macro
Micro

Modalità didattica

Lezioni e tutorial

Materiale didattico

Lectures slides
www.andreacolciago.com
Book:
Asset Pricing, John Cochrane

Periodo di erogazione dell'insegnamento

October-January

Modalità di verifica del profitto e valutazione

Written examination with numerical exercises

Orario di ricevimento

by appointment

Sustainable Development Goals