

	INSEGNAMENTO
DENOMINAZIONE	MATEMATICA FINANZIARIA
TIPOLOGIA	Affine - integrativa
CORSO DI LAUREA E ANNO DI CORSO	ECONOMIA E AMMINISTRAZIONE DELLE AZIENDE
CREDITI	6
PERIODO DI SVOLGIMENTO	II SEMESTRE
ORARIO LEZIONI	Riservato alla Segreteria
AULA LEZIONI	Aula VIII
	DOCENTE
NOME	Lucianna Cananà
E-MAIL	Lucianna.canana@uniba.it
TELEFONO	099/7720629
PAGINA WEB	http://www.uniba.it/corsi/economia-amministrazione-aziende/docenti/canana-Lucianna
RICEVIMENTO	Lunedì ore 9:00 alle ore 11:00
DIPARTIMENTO	Dipartimento Jonico in "Sistemi giuridici ed economici del Mediterraneo: società, ambiente, culture"
	CORSO
PROGRAMMA DEL CORSO	<p style="text-align: center;">UNIVERSITA' DEGLI STUDI DI BARI ANNO ACCADEMICO 2016-17 DIPARTIMENTO JONICO IN SISTEMI GIURIDICI ED ECONOMICI DEL MEDITERRANEO: SOCIETA' AMBIENTE E CULTURE</p> <p style="text-align: center;">PROGRAMMA DELL'INSEGNAMENTO DI MATEMATICA FINANZIARIA DEL CORSO DI LAUREA IN ECONOMIA E AMMINISTARZIONE DELLE AZIENDE</p> <p>Operazioni finanziarie in condizioni di certezza. Grandezze fondamentali della matematica finanziaria. Esempi introduttivi. Definizioni fondamentali. La legge esponenziale. La funzione esponenziale come legge di equivalenza finanziaria. Tassi e intensità equivalente in regime esponenziale. Valore di una operazione finanziaria in base alla legge esponenziale. Proprietà funzionali della legge esponenziale. Scomposizione di operazioni finanziarie. Rendite e piani d'ammortamento. Definizioni preliminari. Valore attuale di rendite a rate costanti. Rendite frazionate. Le operazioni di rendita nell'aspetto dinamico. Il piano d'ammortamento. Tasso interno di rendimento di un'operazione finanziaria. Il problema del tasso interno. Caso di pagamenti periodici. Caso di pagamenti non periodici. La funzione valore. Proprietà formali. La variabile tempo e la funzione valore. Intensità istantanea di interesse. Intensità e tassi di rendimento a scadenza. Valore, tasso interno di rendimento, rendimento periodale di un flusso di importi.</p> <p>Operazioni finanziarie e struttura del mercato. La funzione valore e struttura del mercato. La funzione valore e il</p>

	<p>mercato dei capitali. L'ipotesi di assenza di arbitraggi non-rischiosi. Relazioni di arbitraggio tra tassi (e intensità) a pronti ed a termine. La struttura per scadenza dei tassi di interesse. Proprietà di consistenza. Esempi. Indici temporali e indici di variabilità. Indici temporali di un flusso di importi. Maturity, durata media, duration. Proprietà "baricentrali" della duration. Duration di rendite posticipate. Duration di titoli obbligazionari con cedole. Misure di dispersione temporale di un flusso di importi. Indici di variabilità di un valore. Variazione relativa, elasticità, convexity, convessità relativa. Proprietà differenziali, Leasing Finanziario.</p> <p>Immunità di importi: Teorie semideterministiche, teorema di Fischer weil l'immunità classica. Copertura di una uscita singola. L'ipotesi di shift additivi. Il teorema di Fischer e Weil. Tecniche di assetliability management.</p> <p>NUMERO ORE 48</p> <p>ORGANIZZAZIONE DEL CORSO: lezioni frontali ed esercitazioni</p> <p>E-MAIL DEL DOCENTE: Lucianna.canana@uniba.it</p>
TESTI CONSIGLIATI	BIBLIOGRAFIA: F. Moriconi, Matematica Finanziaria, il Mulino, Bologna
OBIETTIVI SPECIFICI DEL CORSO	Il corso si propone di affrontare i concetti della Matematica Finanziaria classica e si propone di fornire gli elementi teorici che permettono di risolvere i principali problemi finanziari in condizioni di certezza.
CAMBI DI CORSO	Secondo quanto previsto dal regolamento didattico
PROPEDEUTICITA'	Matematica per l'economia
MODALITA' DI VERIFICA	Scritto ed orale
STUDENTI ERASMUS	si
ASSEGNAZIONE TESI	Secondo quanto previsto dal regolamento didattico