ARGOMENTI TESI

Valutazione di derivati su più attività

Valutazione e copertura di derivati in mercati incompleti: risk minimization - mean variance hedging

Valutazione di derivati con sottostanti non negoziabili: il prezzo d’indifferenza

Modelli a volatilità stocastica, valutazione di derivati nel modello di Heston

Modelli per il rischio di credito: strutturali - *intensity based*- valutazione di prodotti sensibili al rischio di default (DZCB-CDS)- rischio di controparte (CVA)

Assicurazioni: modello di Lundberg - valutazione di derivati sulla vita *unit-linked*

Processi di diffusione con salti e applicazioni