

Nome e Cognome: _____ Matricola: _____

C.d.L.M. *Finanza e Assicurazioni*

METODI E MODELLI PER LA FINANZA (9 CFU) – A.A. 2018/2019

Esame 10/01/2020

Esercizio 1. Dimostrare la formula della *Put-Call parity* nel caso di derivati europei il cui sottostante è un tasso di interesse.

Esercizio 2. Descrivere il modello di Hull-White per la dinamica del tasso a breve e calcolare il prezzo di uno Zero-Coupon-Bond quando il tasso di interesse evolve secondo un tale modello.

Esercizio 3. Dare la definizione di *tempo d'arresto* e descrivere la filtrazione associata.

Calcolare il prezzo di uno Zero-Coupon-Bond soggetto a fallimento, quando si considera l'approccio *without recovery* e l'approccio *with recovery of treasury*.