

**Corso di laurea specialistica in Scienze Fisiche**  
**A.A. 2005-2006**  
**Fisica e Finanza**

Marzia De Donno  
Roberto Renò

Programma di massima:

- Introduzione all'integrazione stocastica e formula di Ito
- Equazioni differenziali stocastiche
- Mercati a tempi continui: arbitraggio e completezza
- Modello di Black e Scholes: pricing e hedging di derivati
- Greche

Testo di riferimento:

T. Björk: *Arbitrage Theory in Continuous Time*, Oxford University Press