

Indice

<i>Introduzione</i>	5
----------------------------	----------

<i>Capitolo 1: Misure di rischio globale</i>	9
---	----------

1.1 - Definizioni generali	9
1.2- L'approccio tradizionale	13
1.3- L'approccio assiomatico	18
1.4- Misure di rischio downside: l'approccio del Value at risk	24
1.5- Altre misure di rischio downside	35

<i>Capitolo 2: Metodi di calcolo delle misure di rischio downside</i>	43
--	-----------

2.1- Introduzione	43
2.2- Metodi analitici	44
2.3- Metodi di full valuation: simulazione storica	52
2.4- Metodi di full valuation: simulazione stocastica	55
2.5- Ulteriori considerazioni	58

<i>Capitolo 3: Misure di rischio locale</i>	61
--	-----------

3.1- Concetti generali	61
3.2- Le greche di un portafoglio di opzioni	62
3.2- La duration come misuratore del rischio di un portafoglio obbligazionario	65

<i>Capitolo 4: Tecniche di mapping</i>	73
---	-----------

4.1- Introduzione	73
4.2- Mapping di titoli azionari	74
4.3- Mapping di forward e future	75
4.4- Mapping di portafogli di coupon bond	76
4.5- Mapping di floating bond	79
4.6- Mapping di plain vanilla interest rate swap	80
4.7- Mapping di FRA	81
4.8- Mapping di posizioni creditorie in valuta estera	82
4.9- Mapping di currency forward	82
4.10- Mapping di portafogli di opzioni	84

<i>Capitolo 5: Esercizi svolti</i>	85
---	-----------

<i>Bibliografia</i>	101
----------------------------	------------