UNIVERSITÀ DEGLI STUDI DI UDINE

DIPARTIMENTO DI SCIENZE ECONOMICHE E STATISTICHE

Giovedì **26 marzo 2015**
dalle **ore 15.00**

presso la sala riunioni DIES Kersevan

si svolgerà un

SEMINARIO

sui temi:

TERM STRUCTURE MODELS WITH CONVERGING FORWARD RATES

Relatore:
MICHEL VELLEKOOP
University of Amsterdam

^^^^^^^^

A FOURIER-COSINE EXPANSION METHOD FOR FITTING LOSS DISTRIBUTIONS AND ITS APPLICATION TO RISK MEASUREMENT

Relatore:
XIAO WEI
Central University of Economic and Finance Beijing

^^^^^^^^

USING GAP OPTIONS AS A PROTECTION AGAINST MARKET CRASH: APPLICATION TO CPPI

Relatore:
LUDOVIC GOUDENEGE
CNRS and Ecole Central Paris

La comunità universitaria è invitata a partecipare

33100 UDINE - Via Tomadini, 30/A - Tel. 0432/249380 - Fax: 0432/249229