



Avviso di Seminario

Lunedí 6 Giugno 2005 alle ore 12.00

presso l' Aula A02

del Dipartimento di Fisica e Tecnologie Relative

Viale delle Scienze, Edificio 18, Palermo

il

Dr. Andrea Claudio Cosentini

di Unicredit Banca Mobiliare (UBM), Milano

terrà un seminario dal titolo:

*Opzioni fortemente skew-sensitive sul mercato
finanziario*

Abstract

Verrà esposta una fotografia di una particolare famiglia di opzioni, quelle molto sensibili alla skewness della volatilità. Si mostrerà come, utilizzando il modello classico di Black-Scholes, si ottenga sia un mispricing dell' opzione che una cattiva gestione dei rischi ad essa connessi. Si passerà quindi ad esaminare modelli alternativi diffusi sul mercato.

Per informazioni contattare R. N. Mantegna (091-6615074 mantegna@unipa.it) *Dipartimento di Fisica e Tecnologie Relative*, Viale delle Scienze, Edificio 18, Palermo oppure consultare il sito internet <http://lagash.dft.unipa.it> alla pagina *Seminars*.

