

## MODALITA' DI SVOLGIMENTO DELL'ESAME

### 1. Modalità dell'esame di carattere generale

L'esame si svolge con le seguenti modalità di carattere generale:

- (1) Per potersi presentare all'esame lo studente deve aver compilato il questionario di valutazione dell'insegnamento.
- (2) L'esame consiste della sola prova orale, ma gli studenti al momento dell'esame devono presentare la risoluzione scritta di due esercizi. Il primo è relativo agli argomenti svolti nel Capitolo 1 con particolare riguardo ai regimi di capitalizzazione, alle rendite con le varie applicazioni viste a lezione e alla definizioni di portafoglio e di portafoglio di arbitraggio. Il secondo è relativo agli argomenti svolti nei Capitoli 5 e 6: integrale stocastico di Itô, differenziale stocastico con la corrispondente relazione integrale, formula di Itô, equazioni differenziali stocastiche. Gli esercizi vengono assegnati a ciascuno studente durante il periodo delle lezioni.
- (3) Vengono fissati appelli periodici, ma gli studenti che non riescono a essere presenti a tali appelli possono concordare direttamente via e-mail con la docente un'ulteriore data.
- (4) Dopo la discussione sugli esercizi viene chiesto al candidato di esporre in maniera dettagliata un argomento a sua scelta.
- (5) Le domande successive verteranno su tutto il programma svolto a lezione, ma non verranno richiesti dettagli dimostrativi.
- (6) Il voto finale terrà conto di tutte le parti dell'esame.

### 2. Modalità dell'esame a distanza

L'esame, a causa delle restrizioni dovute al covid-19, si svolgerà a distanza. Le modalità di svolgimento sono le seguenti.

- (1) Per potersi presentare all'esame lo studente deve aver compilato il questionario di valutazione dell'insegnamento.
- (2) Per quanto riguarda lo svolgimento scritto dei due esercizi assegnati durante il periodo delle lezioni, questo va inviato alla docente via e-mail due giorni prima dell'esame, entro le 18. Si può presentare un file pdf ottenuto scrivendo

in LaTeX oppure scannerizzando, eventualmente anche con lo smartphone, dei fogli (bianchi e senza righe o quadretti) scritti a mano in modo chiaro. Se si trovano delle difficoltà per la scansione, si possono anche inviare le foto dei fogli, purché siano leggibili.

- (3) L'esame si svolge mediante Google Meet.
- (4) Il giorno prima dell'appello la docente invia una mail ai candidati in cui è indicato per ognuno l'orario di inizio della prova.
- (5) Per l'esame a distanza si richiede che lo studente abbia a disposizione un pc ed uno smartphone.
- (6) Nel giorno e nell'orario fissato la docente apre una conferenza Meet ed invia una mail allo studente con l'invito di partecipazione.
- (7) Lo studente si collega a Meet e attiva webcam e microfono per tutta la durata della prova.
- (8) Avviata la video-conferenza, lo studente deve far sì che venga inquadrata la sua figura e lo spazio di lavoro sgombro: sul tavolo ci devono essere solo lo smartphone (eventualmente con relativo supporto), carta e penna.
- (9) In primo luogo la docente effettua il riconoscimento del candidato che deve mostrare un documento d'identità.
- (10) L'esame prosegue con le modalità esposte nel paragrafo precedente.
- (11) Per le domande che richiedono una risposta scritta, lo studente deve inquadrare con lo smartphone, pure collegato a Meet, il foglio su cui scrive in modo tale che la docente possa leggere chiaramente ciò che è scritto.
- (12) Il voto finale ovviamente viene inserito su Studiare.