



SCUOLA
NORMALE
SUPERIORE

venerdì 28 marzo 2014

Scuola Normale Superiore
Pisa

Andrea PALLAVICINI

Banca IMI, Milano e Imperial College, London

Terrà un mini-corso dal titolo:

“Credit Risk Modelling Before and After the Crisis”

Program

Aula Bianchi, 10:00 – 12:00

1. *Credit Derivatives*
2. *Pre-Crisis Pricing: multi-name credit products*

Aula Mancini, 14:00 – 16:00

3. *Post-Crisis Pricing: credit, collateral and funding*
4. *Pricing Derivatives under CSA or CCP Clearing*

Tutti gli interessati sono invitati a partecipare.

Classe di Scienze