

DOMANDA EXCEL

- Esercizio sulla perdita: *Esercizio 3*, primi tre punti
- Esercizio sulla perdita: *Esercizio 4*
- Esercizio sulla perdita: *Esercizio 8*
- Analisi discriminante: *Esercizio 2*
- Analisi discriminante: *Esercizio 3* e fare il grafico
- Credit risk+: *Esercizio 1*
- Credit risk+: *Esercizio 2*
- Creditmetrics: *Esercizio due esposizioni*
- Creditmetrics: *Esercizio m esposizioni indipendenti*

DIMOSTRAZIONE/ DOMANDA PRATICA

- Dimostrazione dell'approssimazione della binomiale con la Poisson
- Dimostrazione funzione di probabilità e fgp del miscuglio Gamma Poisson
- Scrivi la formula di P approssimata in Credit Risk+
- Scrivi la formula della Fgp ed elencane le proprietà (tipo trasformazione lineare, somma e corollario)
- Fgp della variabile casuale Z (ottenuta da una combinazione lineare di variabili Poisson indipendenti) e dimostrazione
- Quale uso può essere fatto della fgp nel modello Credit Risk+?
- Proprietà del miscuglio di Poisson
- Dimostrazione della fgp Gamma Poisson
- Dimostrazione valore atteso e varianza di un miscuglio di k variabili casuali discrete
- Definizione di miscuglio e dimostrazione che la vc somma di miscugli è la somma dei componenti del miscuglio

Molto molto MOLTO probabili

DOMANDA ORALE

- Parla del funzionamento del modello Credit Metrics in generale
- Cos'è la PD e come la si stima (slide Analisi discriminante)
- Cosa è l'analisi discriminante
- Parla del funzionamento del modello Credit Risk+ in generale, perché utilizziamo la Poisson come distribuzione?
- Cosa è la quota di recupero? Come la si può calcolare?
- Come si individua la relazione tra le esposizioni in Credit Metrics?
- Parla della probabilità d'insolvenza
- Parla della probabilità di default in generale