UNIVERSITÀ
DEGLI STUDI DI MILANO-BICOCCA

COURSE SYLLABUS

Big Data in Business, Economics and Society

2122-2-F9101Q030-F9101Q030M

Obiettivi

Mostrare alcuni dei modelli classici per la gestione di un portafogli azionario

Contenuti sintetici

Il modello di selezione del portafogli di Markowitz con alcune delle sue estensioni

Programma esteso

Il modello di selezione del portafogli di Markowitz (1952): concetti iniziali, derivazione matematica e suoi limiti
L'estensione minima varianza
L'estensione risk parity

Prerequisiti

Nozioni base di calcolo delle probabilità e ottimizzazione vincolata

Modalità didattica

Lezioni frontali erogate anche in modalità remota

Materiale didattico

Materiale predisposto dal docente

Periodo di erogazione dell'insegnamento

Le lezioni sono previste con il seguente calendario:

marzo 2022
martedì 8 (10:30-12:30)
giovedì 10 (11:30-13:30)
venerdì 11 (10:30-13:30)
martedì 15 (10:30-12:30)
giovedì 17 (11:30-13:30)
martedì 22 (10:30-12:30)
giovedì 24 (11:30-13:30)
venerdì 25 (13:30-16:30)
martedì 29 (10:30-12:30)
giovedì 31 (11:30-13:30)

aprile 2022
venerdì 1 (13:30-16:30)

Modalità di verifica del profitto e valutazione

L'esame verterà su una prova orale che si può declinare nei seguenti modi:
• colloquio sugli argomenti svolti a lezione con svolgimento di una parte numerica
• relazione su argomenti di approfondimento non trattati a lezione e decisi con il docente

Orario di ricevimento

gli orari di ricevimento (che si svolgeranno in via remota) verranno comunicati settimana per settimana