UNIVERSITÀ
DEGLI STUDI DI MILANO-BICOCCA

COURSE SYLLABUS

Risk Management

2122-2-F8204B036-F8204B036M

Obiettivi formativi

Lo scopo del corso è quello di introdurre gli studenti alla moderna teoria finanziaria del rischio ed alle principali misure di rischio elaborate, con particolare enfasi sulle elaborazioni numeriche.

Contenuti sintetici

Introduzione a rischio e incertezza; la frontiera efficiente; misure di rischio; backtests

Programma esteso

1. Rischio e rendimento;
2. Il modello media varianza;
3. La frontiera efficiente ed il CAPM;
4. La frontiera efficiente in presenza di vincoli di portafoglio;
5. Definizioni di misure di rischio;
6. Le principali misure di rischio: Value-at-Risk e Expected Shortfall;
7. Implementazione numerica delle misure;
8. Backtests;
9. Copule.

Prerequisiti

Corsi di Programmazione in R, Teoria finanziaria e Statistica.

Metodi didattici

Lezioni frontali ed al computer. Esercitazioni.

Modalità di verifica dell'apprendimento

Esercizi numerici al computer. Viene fornito un elenco di 5/6 quesiti che coprono tutto il programma svolto e che richiedono elaborazioni numeriche al computer. Può venire richiesto di sapere scrivere una funzione in R ad hoc per svolgere alcuni quesiti.

Testi di riferimento

Dispense predisposte dal docente

Periodo di erogazione dell’insegnamento

Primo semestre

Lingua di insegnamento

Italiano