

UNIVERSITÀ DEGLI STUDI DI MILANO-BICOCCA

COURSE SYLLABUS

Risk Management

2223-2-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
Sustainable Development Goals