



UNIVERSITÀ
DEGLI STUDI DI MILANO-BICOCCA

COURSE SYLLABUS

Statistical Risk Management M

2526-2-F8204B036

Obiettivi formativi

Obiettivo dell'insegnamento è fornire agli studenti gli strumenti teorici e applicativi necessari alla gestione del rischio finanziario (di mercato). In particolare, lo studente apprenderà come misurare il rischio di titoli e contratti, come creare portafogli finanziari, come prezzare la maggior parte dei contratti finanziari derivati e come usare metodi statistici per stimare tutte le quantità necessarie a portare a termine tali compiti.

Gli obiettivi dei due moduli sono discussi nei rispettivi syllabi.

Contenuti sintetici

Si consultino i syllabi dei due moduli

Programma esteso

Si consultino i syllabi dei due moduli

Prerequisiti

Si consultino i syllabi dei due moduli

Metodi didattici

Si consultino i syllabi dei due moduli

Modalità di verifica dell'apprendimento

L'esame avviene nello stesso giorno per i due moduli in laboratorio informatico e allo studente è richiesta la soluzione di problemi per mezzo della scrittura di codice R. L'esame inizia con la parte di *Risk Management* e poi segue la parte di *Computational Finance and Financial Econometrics*. Le due parti durano un'ora ciascuna e preferibilmente, ma non obbligatoriamente, sono da sostenere nel medesimo appello (preparare i due moduli assieme migliora il vostro apprendimento della materia). Se uno dei due moduli non fosse sufficiente, il voto del modulo sufficiente verrà conservato fino al superamento dell'esame dell'altro modulo.

Si consultino i syllabi dei due moduli per maggiori dettagli.

Testi di riferimento

Si consultino i syllabi dei due moduli

Periodo di erogazione dell'insegnamento

Primo semestre, ma si consultino i syllabi dei due moduli per i dettagli

Lingua di insegnamento

Si consultino i syllabi dei due moduli

Sustainable Development Goals

ISTRUZIONE DI QUALITÀ | LAVORO DIGNITOSO E CRESCITA ECONOMICA | IMPRESE, INNOVAZIONE E INFRASTRUTTURE
