



UNIVERSITÀ  
DEGLI STUDI DI MILANO-BICOCCA

## COURSE SYLLABUS

### Statistical Risk Management M

2627-2-F8206B026

---

#### 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

---