



Università degli studi di Cagliari
Facoltà di Scienze Economiche, Giuridiche e Politiche

Titolo del seminario	<i>Finanza quantitativa e mercati di borsa: analisi e gestione operativa dei profili di rischio relativi a bond ed opzioni</i>
Settore Scientifico disciplinare di riferimento	SECS-P/11 ECONOMIA DEGLI INTERMEDIARI FINANZIARI E FINANZA AZIENDALE; SECS-S/06 METODI MATEMATICI DELL'ECONOMIA E
Docenti	Dr. Stefano Zedda, Dr. Giovanni Masala, Prof. Michele Patanè (professore associato di Derivati nell'Università di Siena), dr. Mario Toscano (responsabile banking book BPER)
Semestre nel quale viene impartito	II semestre dell'A.A. 2018/2019
Crediti assegnati	2 CFU
Giorni, Orari, Aula:	orientativamente tra maggio e inizio giugno del 2019, date da definire in collaborazione con il corso di studi; Sono previste sei lezioni frontali ed esercitazioni con impegno di 2h. ciascuna, più verifica finale con durata di ca. 2h.00'). Le attività si svolgeranno, compatibilmente con la disponibilità delle aule, preferibilmente di giovedì e venerdì. Le date, gli orari esatti e le sedi delle lezioni e delle prove finali saranno stabilite per tempo e comunicate con congruo anticipo di almeno 15 giorni prima della realizzazione degli eventi, tramite la pagina istituzionale di UniCa, <i>mailing list</i> e avvisi cartacei. -
Prerequisiti	Iscrizione al corso di laurea magistrale o aver superato l'esame di Matematica Finanziaria
Obiettivi formativi	Il seminario si propone di dare agli studenti partecipanti un approfondimento sul collegamento tra la modellistica quantitativa e l'attività operativa sui mercati finanziari, con focus specifico su bond e opzioni
Contenuti	Il seminario sarà svolto in sei lezioni di due ore ciascuna, dedicate a: (due lezioni per argomento) 1. Modellistica matematica per la determinazione della struttura a termine dei tassi di interesse, e per la valutazione delle opzioni (Dr. Giovanni Masala e Dr. Stefano Zedda); 2. Tecniche di risk management per la gestione ottimale del portafoglio titoli (Prof. M. Patanè) 3. Attività di laboratorio operativo nei mercati di borsa (Dr. M. Toscano)
Metodo d'insegnamento	Lezioni frontali ed esercitazioni operative di simulazione delle operazioni sui mercati di borsa.



Università degli studi di Cagliari
Facoltà di Scienze Economiche, Giuridiche e Politiche

Verifiche dell'apprendimento / procedure di valutazione	È prevista una verifica finale, della durata di due ore, tramite la somministrazione di un questionario contenente quindici domande a risposta multipla e cinque domande a risposta aperta. La valutazione sarà positiva in presenza di un numero di risposte corrette non inferiore a 12 su 20.
Lecture consigliate	Le verifiche finali saranno basate su quanto sviluppato durante il corso. Per una più ampia conoscenza degli argomenti si suggeriscono: Hull, <i>.Opzioni, futures e altri derivati</i> , Ediz. Mylab; Patanè, <i>Interest rate derivatives</i> , McGraw-Hill
Altre informazioni	Modalità d'iscrizione: compilazione di un <i>form</i> , via <i>web</i> , il cui indirizzo sarà comunicato almeno quindici giorni prima dell'avvio delle lezioni <i>con indicazione di</i> : nome, cognome, la denominazione del corso di studi, matricola completa, e anno di corso. Per ragioni organizzative il numero massimo di partecipanti è di 20. Termine ultimo per le iscrizioni: le ore 10.00 del giovedì che precederà l'avvio del seminario. L'ordine di arrivo delle richieste servirà a determinare la graduatoria dei partecipanti al corso. Gli ammessi riceveranno convocazione entro le ore 14.00 del giovedì che precederà la settimana di inizio delle attività.