



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:	Venerdì 31 maggio - ore 9-11 Risk management (Patanè) - ore 11-13 laboratorio operativo di borsa (Toscano) Sabato 1 giugno - ore 9-11 Risk management (Patanè) - ore 11-13 laboratorio operativo di borsa (Toscano) Venerdì 7 giugno - ore 9-11 riferimenti di modellistica (Masala) Giovedì 20 giugno (fondazione di Sardegna) - ore 15.30 – 18 tavola rotonda sul sistema finanziario europeo Venerdì 21 giugno - ore 9-11 prova finale
Prerequisiti	Iscrizione al corso di laurea magistrale
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



	<p>portafoglio titoli (Prof. M. Patanè)</p> <p>3. Attività di laboratorio operativo nei mercati di borsa (Dr. M. Toscano)</p>
Metodo d'insegnamento	Lezioni frontali ed esercitazioni operative di simulazione delle operazioni sui mercati di borsa.
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 due risposte a scelta su 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 del <i>form</i> allegato, da spedire via mail all'indirizzo szedda@unica.it entro le ore 10.00 di giovedì 30 maggio 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. L'ordine di arrivo delle richieste servirà a determinare la graduatoria dei partecipanti al corso. Gli ammessi riceveranno convocazione entro due giorni dalla presentazione della domanda, e comunque entro le ore 14.00 di giovedì 30 maggio.



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

**FINANZA QUANTITATIVA E MERCATI DI BORSA:
ANALISI E GESTIONE OPERATIVA
DEI PROFILI DI RISCHIO
RELATIVI A BOND ED OPZIONI**

Domanda di iscrizione

<i>Nome e cognome</i>	
<i>Denominazione del corso di studi</i>	
<i>Matricola</i>	
<i>anno di corso</i>	
<i>Indirizzo mail</i>	