

Introduzione a Matlab per la finanza

Corso professionalizzante per studenti di Laurea Magistrale

Sally Giuseppe Arcidiacono, Silvia Angilella,

Salvatore Corrente, Damiano Rossello

Il Corso professionalizzante si pone i seguenti obiettivi:

- richiamare in modo applicativo i fondamenti teorici della modellistica matematica per la finanza

Il corso è professionalizzante. È rivolto a studenti di Lauree Magistrali con solide conoscenze di matematica finanziaria, di teoria del portafoglio, strategie di asset allocation, opzioni, nonché conoscenza di base di modelli di pricing.

1st module (SC): L'ambiente matlab; Variabili; comandi; Definizione di matrici e vettori; operazioni matriciali e vettoriali; cicli if...then, for, while; definizione e utilizzo delle funzioni; programmazione lineare e programmazione intera; plot.

2nd module (SA): Teoria del portafoglio; Smart beta asset allocations;

3rd module (DR): Misure di rischio.

4th module (SGA): Modello binomiale e Modello di Black and Scholes.;

References:

Fabrizio Cesaroni, Computational Finance, Matlab oriented programming, Giappichelli, 2020.

Barucci, Marsala, Nenci, Sgarra, Introduzione all'ingegneria Finanziaria, Egea, 2009.