

SEMINARI PROFESSIONALIZZANTI A.A. 2021/2022
cdl magistrali

INTRODUZIONE A MATLAB PER LA FINANZA (EDIZIONE 2022)

Il Corso professionalizzante si pone i seguenti obiettivi:

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

Il corso 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.

1 ° modulo (Prof. Corrente): 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.

2 ° modulo (Prof.ssa Angilella): Teoria del portafoglio; Smart beta asset allocations;

3 ° modulo (Prof. Rossello): Misure di rischio.

4 ° modulo (Prof. Arcidiacono): Modello binomiale e di Black and Scholes.

Calendario incontri in modalità remota su Teams

- Prof. Salvatore Corrente 14 febbraio (15-17.30) 17 febbraio (15-17.30)
- Prof.ssa Silvia Angilella 18 febbraio (15-17.30) 22 febbraio (15-17.30)
- Prof. Damiano Rossello 24 febbraio (10-12.30) 25 febbraio (10-12.30)
- Prof. Sally Arcidiacono 25 febbraio (15-17.30) 26 febbraio (15-17.30)

E' prevista una verifica finale per il conseguimento dei CFU corrispondenti alle ore erogate.

References:

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

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

[Link di collegamento su Teams](#)

IL SEMINARIO È APERTO A STUDENTI
ISCRITTI AI CORSI DI LAUREA MAGISTRALE
DEL DEI

Per partecipare occorre registrarsi
[cliccando qui](#)