

## **Programma di Teoria del Rischio Finanziario (a.a. 2013/2014)**

**(Prof. Bisceglia Mauro)**

Università degli Studi di Bari Aldo Moro

Dipartimento di Scienze Economiche

Corso di Laurea Magistrale in: Statistica per le Decisioni Finanziarie e Attuariali (8 CFU)

### Pre-requisiti

Conoscenze di base di Matematica per l'Economia e Matematica Finanziaria.

### Obiettivi del corso

Acquisire conoscenze e strumenti utili per affrontare studi avanzati in ambito finanziario. Essere in grado di effettuare scelte e valutazioni su investimenti rischiosi, anche in ambito incerto.

### Programma

- I – Premesse di calcolo delle probabilità.
- II - Elementi di Teoria del portafoglio:
  - Analisi di media varianza;
  - Criterio di dominanza stocastica;
  - Capital Asset Pricing Model (CAPM),
  - Arbitrage Pricing Theory (APT).
- III - Elementi di teoria delle opzioni finanziarie.
- IV – Value at Risk (VAR) e dintorni.
- V – Misure di rischio.
- VI – Applicazioni.

### TESTI CONSIGLIATI:

D.M. Cifarelli, Introduzione al calcolo delle probabilità, Mc Graw-Hill;

E. Saltari, Introduzione all'economia finanziaria, Carocci Editore;

P.Pianca, Elementi di teoria delle opzioni finanziarie, G. Giappichelli Editore.

### Modalità di accertamento conoscenze

- Esoneri: Si
- Prova Scritta: Si
- Colloquio Orale: Si

### Forme di assistenza allo studio

- Corso presente nella zona in e-learning del Sito Web di Facoltà: Si

#### Organizzazione della didattica

- Cicli interni di lezione: No
- Corsi integrativi: No
- Esercitazioni: Si
- Seminari: No
- Attività di laboratorio: No
- Project work: No
- Visite di studio: No