

Introduzione all'Ingegneria Finanziaria

Corso professionalizzante per studenti di Laurea Magistrale

Vincenzo Eugenio Corallo

- **Giovedì 7 Maggio 2020, ore 10:00-12:30** (Aula da definire) - Prima parte di richiami di Finanza Matematica
- **Giovedì 7 Maggio 2020, ore 14:30-17:00** (Aula da definire) - Seconda parte di richiami di Finanza Matematica
- **Venerdì 8 Maggio 2020, ore 10:00-12:30** - (Aula da definire) - Introduzione al Counterparty Credit Risk (CCR) e ai *valuation adjustments* (XVA)
- **Venerdì 8 Maggio 2020, ore 14:30-17:00** - (Aula da definire) - Introduzione al linguaggio Python
- **Giovedì 28 Maggio 2020, ore 10:00-12:30** - (Aula da definire) - Configurazione PyCharm e Anaconda. Introduzione al sistema di controllo versione Git
- **Giovedì 28 Maggio 2020, ore 14:30-17:00** - (Aula da definire) - Introduzione al codice sorgente C++ di QuantLib e alle interfacce di QuantLib per Python e Excel
- **Venerdì 29 Maggio 2020, ore 10:00-12:30** - (Aula da definire) - Esercitazione QuantLib su Python
- **Venerdì 29 Maggio 2020, ore 14:30-17:00** (Aula da definire) - Project work di gruppo

Il Corso professionalizzante si pone i seguenti obiettivi:

- richiamare i fondamenti teorici di della modellistica matematica per la finanza
- fornire una disamina delle principali convenzioni di mercato
- fornire gli elementi di conoscenza di base del linguaggio di programmazione Python

-
- introdurre la libreria finanziaria *open source* QuantLib, ampiamente usata per il pricing di strumenti finanziari
 - illustrare un esempio di *workflow* industriale di sviluppo condiviso di un progetto

Il corso è professionalizzante. E' rivolto a studenti di Lauree Magistrali con solide conoscenze di teoria delle probabilità ed in particolare di calcolo stocastico nonchè conoscenza di base di modelli di pricing e linguaggi di programmazione.