

Modalità di Verifica Finale

Introduzione all'Ingegneria Finanziaria
Seminario Professionalizzante

Vincenzo Eugenio Corallo, Ph. D

Sapienza Università di Roma

vincenzo.corallo@uniroma1.it

Data e modalità di verifica

- Le slide del corso sono disponibili al repository GitHub *<https://github.com/Vincenzocr/Slides-Ingegneria-Finanziaria-Unict>*
- La verifica finale si terrà durante l'incontro del **12 Giugno 2021**;
- Gli studenti saranno coinvolti nella presentazione di un **case study** realizzato in **gruppo**;
- Ogni gruppo di studenti avrà a disposizione **20 minuti** per l'esposizione del proprio elaborato;

Contenuto del case study

- Il *case study* consisterà nell'analisi di un topic di Ingegneria Finanziaria e coinvolgerà l'impiego di **uno o più modelli teorici** anche non necessariamente trattati durante le lezioni;
- Dovrà essere realizzato un algoritmo scritto in linguaggio **Python**. L'utilizzo della libreria *open source* **QuantLib** non è obbligatorio ma vivamente consigliato;
- Il progetto dovrà essere versionato col sistema **Git**;
- È stato fornito un **dataset di esempio**, contenente dati spot, curve e superfici di volatilità, riferito al 14/04/2020;
- Dovrà essere redatto un file di **documentazione** del progetto: a tal proposito vivamente consigliato l'impiego di LaTeX in quanto anch'esso versionabile.

Vincoli, istruzioni e suggerimenti

- È obbligatorio creare un repository, non necessariamente pubblico, sul sito **github.com**;
- Nella **history** del *repository* dovrà figurare almeno un *commit* per ogni membro del gruppo. In altre parole, ognuno degli studenti dovrà dimostrare di essere stato contributore al repo del proprio team!
- **Hint:** la composizione dei gruppi sarà libera; tuttavia nella reciproca conoscenza fra gli studenti, si invita a costituire gruppi eterogenei e a distribuire e a non concentrare nei gruppi, studenti con spiccate skills analitiche, di programmazione, documentali o espositive;
- **Hint:** non ricercate necessariamente argomenti complicati; una buona analisi deriva il più delle volte dall'osservare sfumature anche su temi semplici, ma osservati con senso critico.

Da dove trarre ispirazione? - 1

- È innegabile che la fonte elettiva di ispirazione per formulare una buona domanda di ricerca sono e rimangono gli **articoli scientifici** pubblicati in rivista; di seguito alcuni siti gratuiti da poter consultare:

Google Scholar

scinapse

SSRN

arXiv.org








- Assolutamente da non sottovalutare sono le testate giornalistiche specializzate in ambito di *capital markets* e che offrono anche un database di articoli scientifici (questi ultimi seppur a pagamento), su tutti:

Risk.net

mercati, intermediari, istituzioni
FinRiskAlert

Da dove trarre ispirazione? - 2

Oggi giorno, innumerevoli spunti anche di altissimo livello possono essere tratti da:

- **Guide e manuali:** **QuantLib**
A free/open-source library for quantitative finance
Reference manual - version 1.18
- **Forum:**  StackExchange
Quantitative Finance
- **Canali**  YouTube ^{IT} :  Quantopian
26.100 iscritti  QuantMinds TV
1680 iscritti
- **Gruppi**  :  Quant Finance / Quantitative Finance
15.051 membri  Financial Engineering Group
11.645 membri

Buon lavoro e ... in bocca al
lupo!