

Metodi Quantitativi Profilo Finanziario (seconda parte)

1. FONTI E RACCOLTA DI DATI FINANZIARI

- 1.1 Fornitori di dati finanziari
- 1.2 Codici d'identificazione
- 1.3 Datastream, classi di strumenti finanziari e tipologie di dati

2. PORTFOLIO MODELS - INTRODUCTION (B. CHAPTER 8)

- 2.1 Notazione
- 2.2 Rendimenti percentuali e logaritmici: definizione e proprietà
 - 2.2.1 Il caso con dividendi
- 2.3 Varianza, covarianza e coefficiente di correlazione
- 2.4 Valore atteso e varianza del rendimento di un portafoglio
 - 2.4.1 Caso con due soli titoli
 - 2.4.2 Caso generale
- 2.5 Portafoglio efficiente: concetti generali e definizione

3. INTRODUZIONE AL LINGUAGGIO DI PROGRAMMAZIONE R

- 3.1 Premessa
- 3.2 Installazione
- 3.3 Strutture semplici e strutture di dati
- 3.4 Grafici
- 3.5 Comandi if, for, while, repeat
- 3.6 Funzioni e programmazione da Excel

4. CALCULATING THE VARIANCE-COVARIANCE MATRIX (B. CHAPTER 10)

- 4.1 In Excel
- 4.2 In R
- 4.3 The Single-Index Model

5. CALCULATING EFFICIENT PORTFOLIOS WHEN ARE NO SHORT-SALE RESTRICTIONS (B. CHAPTER 9)
 - 5.1 Notazione e definizioni preliminari
 - 5.2 La matematica della frontiera efficiente
 - 5.3 Implementazione con dati reali
6. THE LOGNORMAL DISTRIBUTION (B. CHAPTER 18)
 - 6.1 Introduzione: il cammino dei prezzi azionari
 - 6.2 La distribuzione lognormale
 - 6.3 Simulazione di variabili aleatorie
 - 6.4 The Geometric Random Walk with Drift
7. VALUE AT RISK: VAR (B. CHAPTER 15)
 - 7.1 Definizione
 - 7.2 Approssimazione tramite la distribuzione Normale
 - 7.3 Critiche alla distribuzione Normale
 - 7.4 La metodologia di simulazione storica
 - 7.5 Osservazioni finali

Testi di riferimento

- Benninga, Simon, Financial Modeling, MIT Press, 2008
(BUL A 658.150285 BEN FIN)