



ALMA MATER STUDIORUM
UNIVERSITÀ DI BOLOGNA



IV EDIZIONE

Master universitario di II livello in

QUANTITATIVE RISK MANAGEMENT



Scadenza bando: *20 novembre 2019*

Immatricolazioni: *dal 10 dicembre 2019 al 27 dicembre 2019*

INFORMAZIONI GENERALI

DIREZIONE

Prof.ssa Sabrina Mulinacci, Dipartimento di Scienze Statistiche "Paolo Fortunati"

PRESENTAZIONE

L'obiettivo del Master in Quantitative Risk Management è quello di formare esperti nella gestione dei rischi degli intermediari finanziari, in grado di svolgere mansioni legate sia all'analisi dell'andamento dei mercati finanziari, sia alla definizione di strategie di gestione dei rischi di mercato, credito e liquidità.

In particolare, il Master fornisce le competenze per affrontare gli aspetti di frontiera nella misura e nella gestione del rischio, nel contesto dei recenti sviluppi della regolamentazione.

PROFILO PROFESSIONALE

Esperto nella misura e gestione dei rischi di mercato, di credito e di liquidità (Quantitative Risk Manager).

RISULTATI ATTESI

Alla fine del corso i partecipanti saranno in grado di utilizzare le tecniche di analisi finanziaria più avanzate, con particolare attenzione ai metodi per la misura e la gestione dei rischi di mercato, di credito e liquidità. I partecipanti acquisiranno inoltre una conoscenza approfondita del funzionamento dei mercati e dei prodotti finanziari e dei più recenti sviluppi di regolamentazione dei mercati e degli intermediari finanziari.

PARTNERSHIP

Il Master nasce dalla collaborazione dei Dipartimenti di Scienze Statistiche e Scienze Economiche dell'Università di Bologna con CRIF SpA, azienda globale specializzata in sistemi di informazioni creditizie e di business information, servizi di outsourcing e processing e soluzioni per il credito.

PIANO DIDATTICO

STRUTTURA DEL MASTER

Dopo una prima parte introduttiva dei concetti principali di probabilità, statistica, econometria, ingegneria finanziaria e istituzioni dei mercati dell'intermediazione finanziaria, il corso introduce gli aspetti di frontiera del rischio di mercato, di credito e di liquidità. Nel campo del rischio di credito, un obiettivo primario del Master è quello di fornire competenze nell'analisi dei cosiddetti "big data", ovvero dell'enorme mole di dati che le aziende finanziarie devono gestire. L'orientamento pratico del percorso di formazione passa attraverso l'uso delle tecniche informatiche più diffuse presso le istituzioni finanziarie; in questo modo si intende favorire l'inserimento dei partecipanti al Master nel mondo del lavoro. Il percorso formativo prevede infine un tirocinio pratico della durata di 300 ore presso CRIF SpA o una delle aziende partner.

Didattica frontale: 240 ore in lingua inglese

Tirocinio/Stage: 300 ore presso CRIF SpA o un'azienda partner

Frequenza: Obbligatoria 80%

Prova finale: sì

Crediti formativi: 60 C.F.U.

INSEGNAMENTI E DOCENTI

Statistics: Michele Costa

Financial econometrics: Luca De Angelis, Luca Fanelli

Volatility modelling: Giuseppe Cavaliere, Anders Rahbek

Programming: Fabio Gobbi, Milo Faccenda

Probability: Sabrina Mulinacci

Financial calculus: Luca Vincenzo Ballestra

Modelling of stock and (fixed) income markets: Silvia Romagnoli

Credit scoring: Gabriele Soffritti

Financial products: Massimiliano Barbi

Financial intermediation: Giuseppe Torluccio

Financial regulation: Andrea Resti, Francesco Cannata

Big data in risk management: Andrea Guizzardi, Silvia Romagnoli, Sergio Pastorello

Market risk: Sabrina Mulinacci, Gian Luca Tassinari

Credit risk: Gian Luca Tassinari, Fabio Gobbi

ALTRE INFORMAZIONI

SEDE DELLE LEZIONI

Bologna – presso CRIF SpA, via della Beverara 19

CALENDARIO

Inizio lezioni: 20 gennaio 2020

Tirocinio formativo: dal 13 luglio 2020 al 20 novembre 2020

Esame finale: ottobre/novembre 2019

Le lezioni si svolgeranno indicativamente dal lunedì al giovedì dalle ore 10:00 alle 16:30 per un totale di 20 ore a settimana di didattica frontale.

DESTINATARI E REQUISITI DI ACCESSO

Il corso è rivolto a laureati magistrali in economia, statistica, matematica, fisica, ingegneria e scienze politiche (con solide basi quantitative).

È richiesta una conoscenza adeguata della lingua inglese, certificazione per un livello B1 o superiore. In assenza di certificato, la conoscenza della lingua inglese verrà valutata in sede di selezione attraverso un colloquio.

CRIF SpA mette a disposizione 5 borse di studio del valore di € 5.000 che verranno assegnate ai candidati classificati nelle prime 5 posizioni della graduatoria di selezione.

ISCRIZIONE

Bando consultabile sul sito web, seguendo il percorso:

www.unibo.it > Didattica > Master universitari

La quota di partecipazione al Master è di € 6.000 da corrispondersi in due rate rispettivamente da € 3.500 e € 2.500.

CONTATTI

master.qrim@unibo.it

<https://master.unibo.it/qrim/it>