

Seminari di Ingegneria Finanziaria

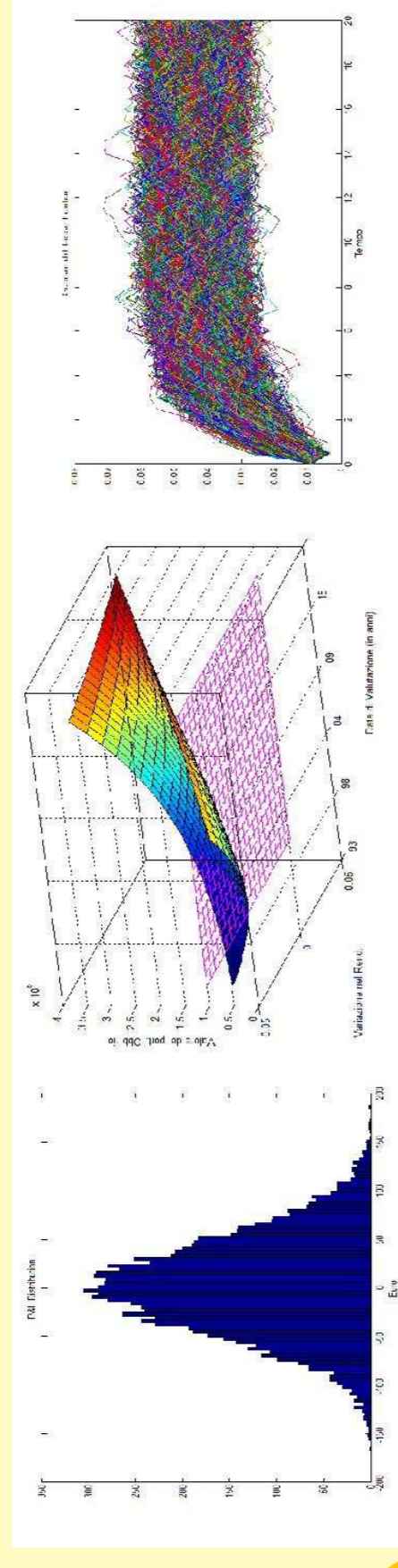
Dipartimento SEMeQ e Fondazione CRT

FONDAZIONE CRT

Una Fondazione attiva



Market, Interest & Credit Risk



I Temi

Il Dipartimento SEMeQ, con il contributo della Fondazione CRT, organizza una serie di seminari di Ingegneria Finanziaria relativi a

- La misurazione del rischio di mercato;
- Simulazione Monte Carlo per la valutazione di equity derivatives;
- Modelli a volatilità stocastica per il mercato interest rate derivatives;
- I derivati di credito.

I relatori sono docenti universitari ed esperti del mondo bancario.

Dove

I seminari si terranno presso il Laboratorio Informativo, primo piano, Facoltà di Economia, Università degli Studi del Piemonte Orientale, Via Perrone 18, 28100 Novara.

Per informazioni, contattare: Gianluca Fusai, gianluca.fusai@eco.unipmn.it

Calendario degli Incontri

- Giovedì 26 novembre, h. 14.00-16.00
Misure di Rischio oltre al VAR
Emanuela Rosazza Gianin
- Giovedì 3 dicembre, h. 14.00-18.00
Metodo Monte Carlo per il pricing di opzioni esotiche
Marco Airoidi
- Martedì 15 dicembre, h. 9.00-13.00
Il modello SABR e il pricing di derivati su tassi
Marco Bianchetti
- Martedì 1° dicembre, h. 9.00-13.00
(data e ora da confermare)
Credit derivatives: i contratti
Roberto Baviera
- Giovedì 10 dicembre, h. 14.00-18.00
Credit derivatives: i modelli single name
Roberto Baviera
- Martedì 22 dicembre, h. 9.00-13.00
Credit derivatives: i modelli multi name
Roberto Baviera

Relatori

- Emanuela Rosazza, Ph.D., è ricercatrice presso il Dipartimento di Metodi Quantitativi dell'Università di Milano Bicocca. La sua attività di ricerca, che vanta numerose pubblicazioni su riviste internazionali, si concentra sul significato delle misure di rischio adottate in campo finanziario con l'obiettivo di *putting order in risk measures*.
- Marco Airoidi, Ph.D., è *Head of Financial Engineering* in Mediobanca. Le sue aree di interesse riguardano: (a) lo sviluppo di librerie di pricing tramite la programmazione ad oggetti; (b) i modelli di pricing su equity e tasso. Tiene ormai da diversi anni un corso di programmazione e di calcolo numerico orientato alla finanza presso il Dipartimento di Fisica dell'Università degli Studi di Milano. Ha anche pubblicazioni relative al pricing di derivati esotici.
- Marco Bianchetti, Ph.D., è *senior quantitative analyst* presso Banca Intesa SanPaolo, Ufficio Pricing e Financial Modeling dove si occupa di pricing e risk management di derivati su tasso, volatilità, e inflazione oltre che di algoritmi per strategie in derivati e model validation. I suoi lavori di ricerca sono sugli stessi temi e sono disponibili su [ssrn.com](http://www.ssrn.com) e sulla sua homepage personale <http://www.bianchetti.org/>.
- Roberto Baviera, Ph.D., è *independent consultant* con www.RondPoint.it, società che offre soluzioni nella realizzazione, implementazione e gestione di processi di Risk e Capital Management. Ha numerose pubblicazioni sul pricing di derivati di tasso e di credito.

Contributo Finanziario

Il ciclo di seminari è organizzato grazie al Contributo della Fondazione CRT, Progetto Alfieri, bando 2007, grant su *Innovazione tecnologica in finanza: grid computing e applicazioni finanziarie al rischio di mercato e al rischio di credito*. Responsabile scientifico: Gianluca Fusai (SEMMeQ, U. Piemonte Orientale).