



ALMA MATER STUDIORUM  
UNIVERSITÀ DI BOLOGNA



Master universitario di II livello in  
**QUANTITATIVE RISK MANAGEMENT**



Scadenza bando: *16 novembre 2016*

Immatricolazioni: *dal 28 novembre 2016 al 12 dicembre 2016*

Anno Accademico 2016 - 2017

# INFORMAZIONI GENERALI

## DIREZIONE

Prof. Luca De Angelis, Dipartimento di Scienze Statistiche, Università di Bologna

## 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 e credito.

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 e di credito (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 e di credito. 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 del Dipartimento di Scienze Statistiche 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 e di credito. 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

**Programming:** Fabio Gobbi, Milo Faccenda

**Probability:** Sabrina Mulinacci

**Financial calculus:** Iliyan Georgiev

**Derivates:** Silvia Romagnoli

**Financial products:** Massimiliano Barbi

**Financial intermediation:** Giuseppe Torluccio

**Financial regulation:** Andrea Resti, Francesco Cannata

**Market risk:** Sabrina Mulinacci, Gian Luca Tassinari

**Credit risk:** Umberto Cherubini, Gian Luca Tassinari

**Credit scoring:** Gabriele Soffritti

# ALTRE INFORMAZIONI

## SEDE DELLE LEZIONI

Bologna – presso CRIF SpA, via della Beverara 19

## CALENDARIO

Inaugurazione: 15 dicembre 2016

Inizio lezioni: 9 gennaio 2017 – Fine lezioni: 14 luglio 2017

Tirocinio formativo: dal 17 luglio 2017 al 22 settembre 2017

Esame finale: 30 settembre 2017

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](http://www.unibo.it) > Didattica > Master universitari

La quota di partecipazione al Master è di € 5.000 da corrisondersi in due rate rispettivamente da € 3.000 e € 2.000.

## CONTATTI

Dott.ssa Virginia Piccirilli

[master.qrim@unibo.it](mailto:master.qrim@unibo.it)

[www.stat.unibo.it/it/attivita-didattica/master-2/qrim](http://www.stat.unibo.it/it/attivita-didattica/master-2/qrim)