



[A000276] - SCELTE DI PORTAFOGLIO E ASSET ALLOCATION

Informazioni generali

Corso di studi	<u>ECONOMIA, BANCA E FINANZA</u>
Tipo di corso	Corso di Laurea
Anno di offerta	2025/2026
Anno di corso	3
Tipo Attività Formativa	Caratterizzante
Ambito	Economico
Lingua di erogazione	ITALIANO
Crediti	8 CFU
Tipo attività didattica	Lezione
Tipo esame	Orale
Valutazione	Voto Finale
Periodo didattico	Primo Semestre (dal 15/09/2025 al 19/12/2025)
Titolari	LIMOSANI MICHELE
Durata	48 ore (48 ore Lezione)
Frequenza	Non obbligatoria
Settore scientifico disciplinare	SECS-P/02
Sede	MESSINA

Obiettivi formativi

Il corso introduce ai modelli delle scelte di portafoglio e la loro relazione con le variabili macroeconomiche. Esso si sofferma inoltre sulla teoria dei mercati efficienti, sulla struttura dei tassi di interesse e sul mercato dei cambi con particolare attenzione alla dinamica del premio di rischio e agli effetti determinati dalla politica fiscale e monetaria. Al termine del corso lo studente sarà in grado di analizzare il profilo rischio-rendimento di singoli titoli e di portafogli di investimenti finanziari e di elaborare una lettura critica integrata di teorie e fatti economico-finanziari.

Prerequisiti

No

Contenuti

Scelte di portafoglio e modelli macroeconomici 1. Analisi del rischio; il rischio e il rendimento delle attività finanziarie; 2. La misurazione del rischio di mercato; 3. Titoli a rendimento certo. 4. la struttura dei tassi di interesse. 5. I modelli di Markowitz e Tobin; le scelte di portafoglio; 6. Il capital Asset Pricing model 7. I modelli fattoriali. 8. Teoria delle option 9. Applicazione del rischio sui mercati valutari; forward e spot exchange rate

Metodi didattici

lezioni frontali e tutorials

esame scritto/orale

Testi

Finanza e Investimenti. Fondamenti matematici. David G. Luenberger. Maggioli Editore 2019