

Corso di Laurea Magistrale in Finanza e Assicurazioni (FINASS)

Dipartimento di Metodi e Modelli per l'Economia, il Territorio e la Finanza
(MEMOTEF)

FACOLTÀ DI ECONOMIA



SAPIENZA
UNIVERSITÀ DI ROMA

Tutti i diritti relativi al presente materiale didattico e al suo contenuto sono riservati a Sapienza e ai suoi autori (o docenti che lo hanno prodotto).
È consentito l'uso personale dello stesso da parte dello studente ai fini di studio. Ne è vietata nel modo più assoluto la diffusione, duplicazione, cessione, trasmissione, distribuzione a terzi o al pubblico pena le sanzioni applicabili per legge.

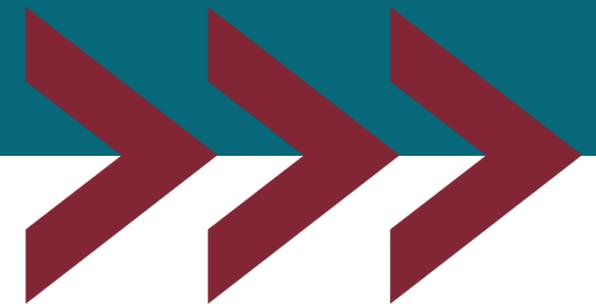


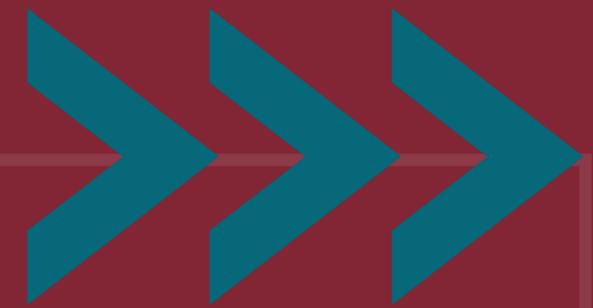
FINASS

Il corso di laurea magistrale in Finanza e Assicurazioni (LM.16) fornisce al laureato i metodi quantitativi e i principali aspetti normativi ed economici dei mercati finanziari per svolgere incarichi di responsabilità in ambito finanziario ed attuariale.

Obiettivi formativi

- Applicazione ed interpretazione di modelli matematici e statistici per l'analisi e la previsione dei mercati (finanziari e assicurativi)
- Progettazione e valutazione di prodotti finanziari/assicurativi
- Implementazione di metodi quantitativi per la misurazione ed il controllo del rischio
- Conoscenza dei principali aspetti normativi ed economici dei mercati





I CURRICULA



FINANZA



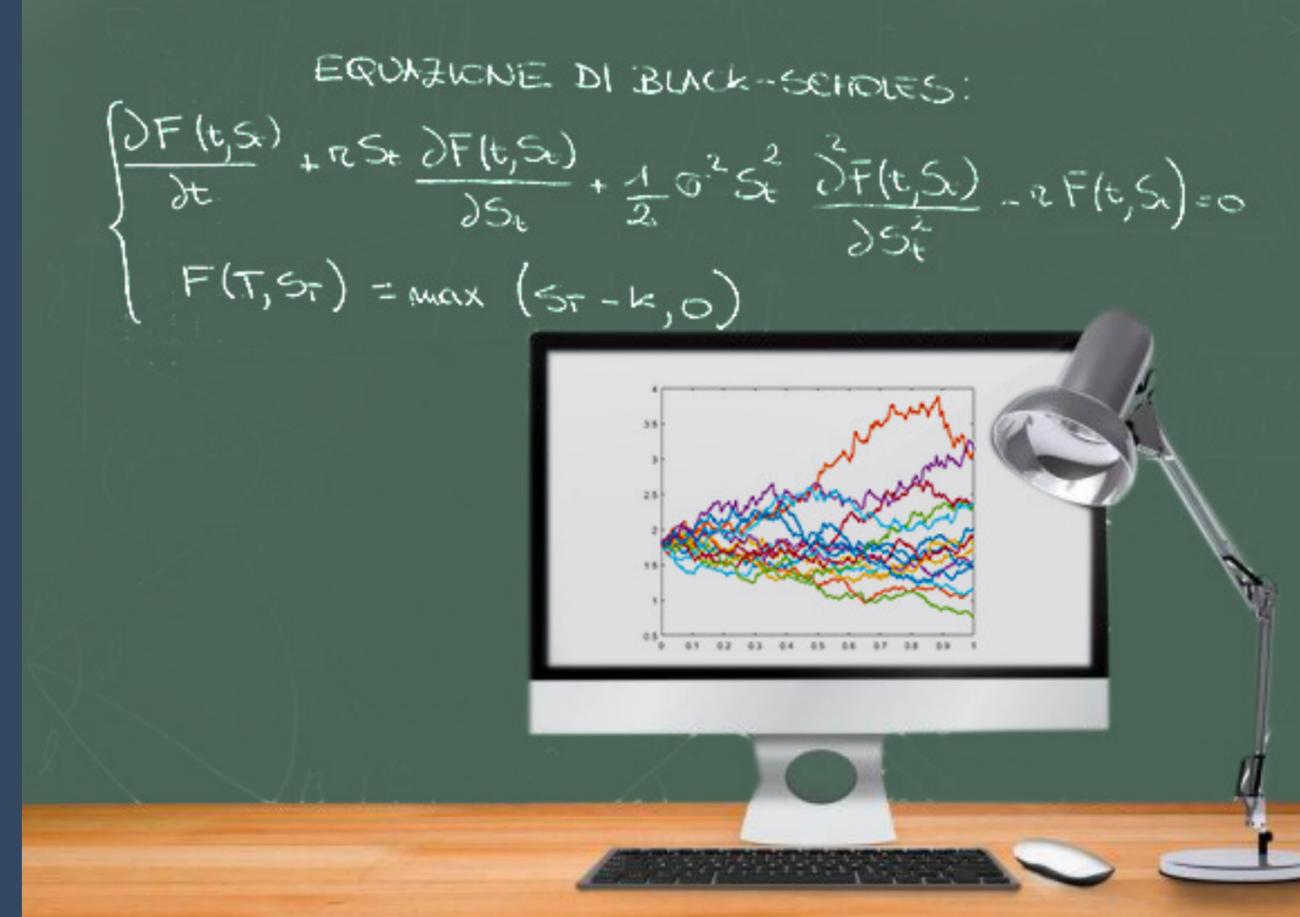
ASSICURAZIONI



FINANCIAL RISK AND
DATA ANALYSIS
(ENGLISH)



Il Curriculum in Finanza è un percorso specializzante nell'ambito della finanza quantitativa. L'obiettivo del corso è offrire una solida preparazione nell'ambito dei modelli matematici e statistici per l'analisi dei mercati finanziari, e delle tecniche informatiche per la loro implementazione, fondamentali per lo svolgimento di incarichi di responsabilità in ambito finanziario.



Curriculum FINANZA

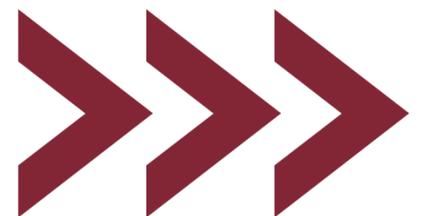
Che cos'è?



Curriculum FINANZA

Cosa si impara?

Il laureato magistrale sarà in grado di utilizzare metodi quantitativi per la misurazione ed il controllo del rischio finanziario in ottica Basilea 3, per mezzo di strumenti computazionali di elevato livello, allo scopo di effettuare pricing ed hedging di strumenti finanziari, nonché gestire portafogli finanziari attraverso opportuna modellizzazione matematica.



Come iscriversi

Accesso diretto per laureati in Scienze dell'economia e della gestione aziendale (L-18, ex D.M. 270/04) e Scienze economiche (L-33, ex D.M. 270/04)

Verifica requisiti di accesso per i laureati di altre classi di laurea:

- 72 CFU in specifici settori scientifico-disciplinari (SSD) (obbligatorio)
- Livello B2 - lingua inglese (consigliato)
- Voto di laurea maggiore o uguale a 90/110 (consigliato)

Gli studenti laureandi possono iscriversi (previa verifica requisiti)



CURRICULUM FINANZA: MODELLO KSA



CONOSCENZE

Matematica avanzata, probabilità e statistica, finanza matematica e finanza aziendale, ottimizzazione finanziaria, econometria



COMPETENZE

Applicare metodi quantitativi per la valutazione e la gestione di prodotti finanziari complessi e del rischio finanziario, in accordo con le più recenti regolamentazioni nazionali ed internazionali, anche grazie all'utilizzo dei più recenti strumenti computazionali



ABILITA'

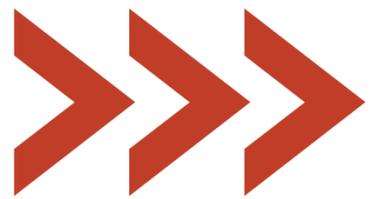
Individuare la modellizzazione teorica più adatta e gli strumenti finanziari più idonei per la gestione di problematiche connesse ai mercati finanziari



- Analista quantitativo
- Consulente e intermediario finanziario
- Gestore di portafogli finanziari e fondi pensione
- Risk manager in ambito finanziario
- Supporto ed integrazione ad attività di ingegneria finanziaria
- Attività di vigilanza presso enti che monitorano il sistema del credito (Banca d'Italia, BCE)

Sbocchi professionali

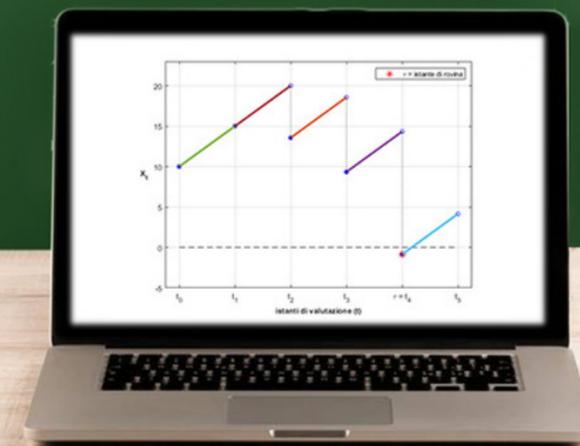




Il Curriculum in Assicurazioni è un percorso specializzante in ambito assicurativo ed attuariale. L'obiettivo del corso è offrire una solida preparazione nell'ambito dei modelli matematici e statistici per l'analisi dei mercati assicurativi, e delle tecniche informatiche per la loro implementazione, fondamentali per lo svolgimento di incarichi di responsabilità in ambito attuariale e previdenziale.

MODELLO DI CRAMER - LUNDBERG:

$$X_t = x + ct - \sum_{i=1}^{N_t} y_i, \quad t \geq 0, \quad N_t \sim Po(\lambda), \quad y_i \sim Exp(\lambda)$$
$$\tau = \min\{t > 0 : X_t < 0\}$$



Curriculum ASSICURAZIONI

Che cos'è?

SOLVENCY II

PILLAR I

QUANTITATIVE
REQUIREMENTS

PILLAR II

REQUIREMENTS
FOR THE
GOVERNANCE AND
RISK MANAGEMENT
OF INSURANCE

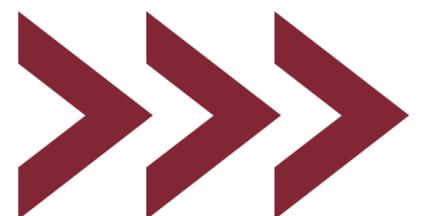
PILLAR III

DISCLOSURE AND
TRANSPARENCY
REQUIREMENTS

Curriculum ASSICURAZIONI

Cosa si impara?

Il laureato magistrale sarà in grado di utilizzare metodi quantitativi per la misurazione ed il controllo del rischio assicurativo e previdenziale in ottica Solvency 2, per mezzo di strumenti computazionali di elevato livello, allo scopo di valutare opportune strategie assicurative e riassicurative, nonché implementare modelli quantitativi per le valutazioni attuariali secondo i principi contabili vigenti.



Come iscriversi

Accesso diretto per laureati in Scienze dell'economia e della gestione aziendale (L-18, ex D.M. 270/04) e Scienze economiche (L-33, ex D.M. 270/04)

Verifica requisiti di accesso per i laureati di altre classi di laurea:

- 72 CFU in specifici settori scientifico-disciplinari (SSD) (obbligatorio)
- Livello B2 - lingua inglese (consigliato)
- Voto di laurea maggiore o uguale a 90/110 (consigliato)

Gli studenti laureandi possono iscriversi (previa verifica requisiti)



CURRICULUM ASSICURAZIONI: MODELLO KSA



CONOSCENZE

Matematica avanzata e matematica attuariale, probabilità e statistica, finanza aziendale e delle assicurazioni, e teoria del rischio



COMPETENZE

Applicare metodi quantitativi per la valutazione e la gestione del rischio in ambito assicurativo, in accordo con le più recenti regolamentazioni nazionali ed internazionali, anche grazie all'utilizzo dei più recenti strumenti computazionali



ABILITA'

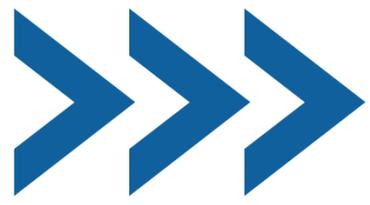
Individuare la modellizzazione teorica più adatta per lo studio e l'analisi dei mercati assicurativi e previdenziali



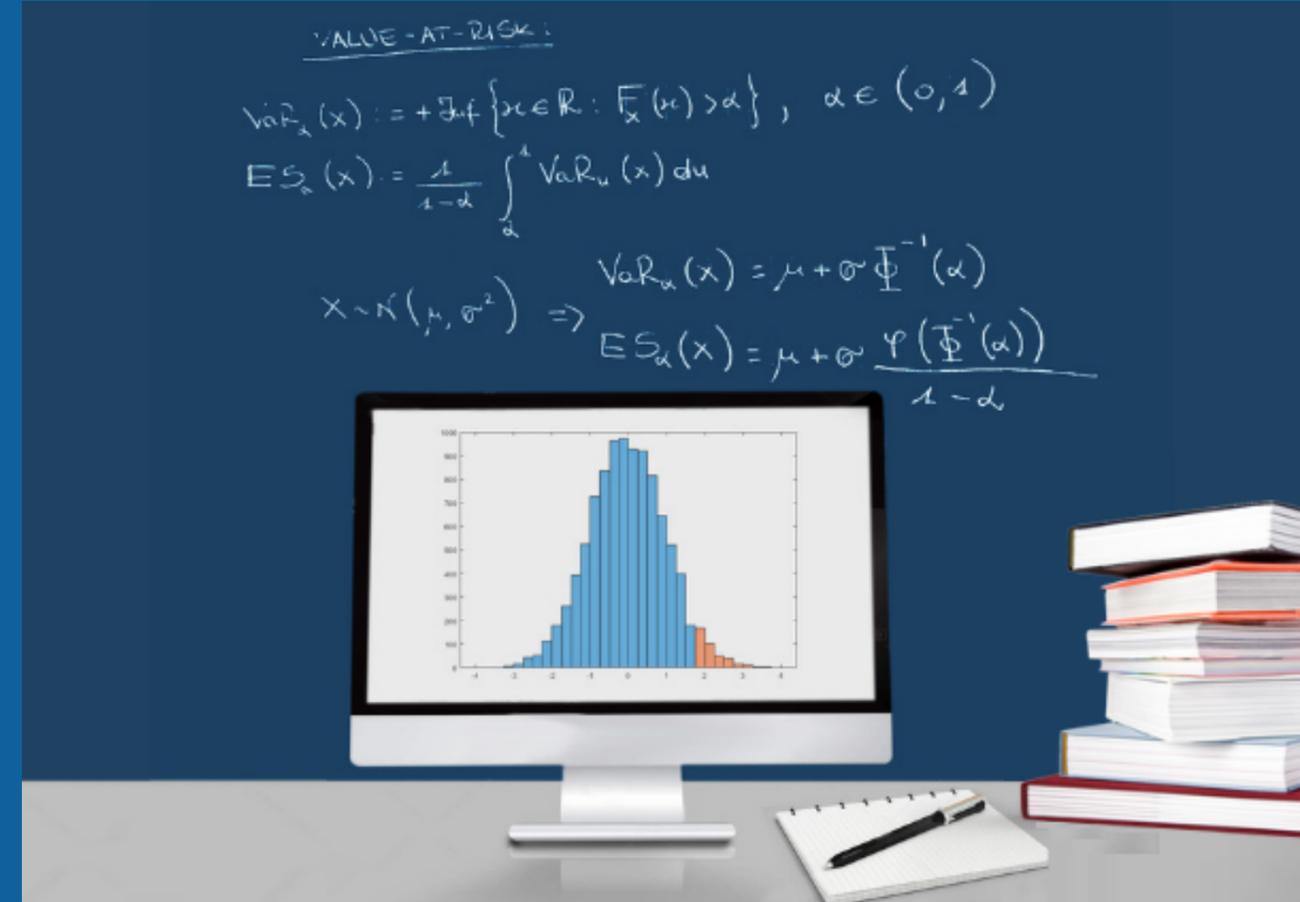
- Attuario (requisito d'accesso per l'esame di Stato)
- Gestore di fondi assicurativi
- Risk manager in ambito attuariale
- Consulente assicurativo
- Attività di vigilanza presso enti che monitorano il sistema delle assicurazioni (IVASS)

Sbocchi professionali





Graduates will acquire quantitative, economic and legal skills useful to analyze time series and implement forecasting methodologies, also in the multivariate framework applied to the dependency analysis



Curriculum FINANCIAL RISK AND DATA ANALYSIS

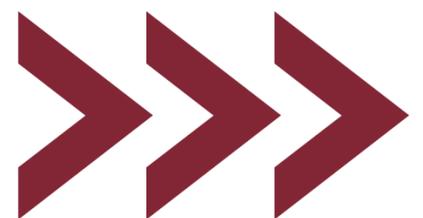
What is it?



Curriculum FINANCIAL RISK AND DATA ANALYSIS

What do you learn?

Graduates will be able to apply quantitative methods and econometric techniques for risk management



How to apply

Bachelor in Economics, Business Administration or other first cycle Degree with adequate academic background (overall 72 ECTS) in:

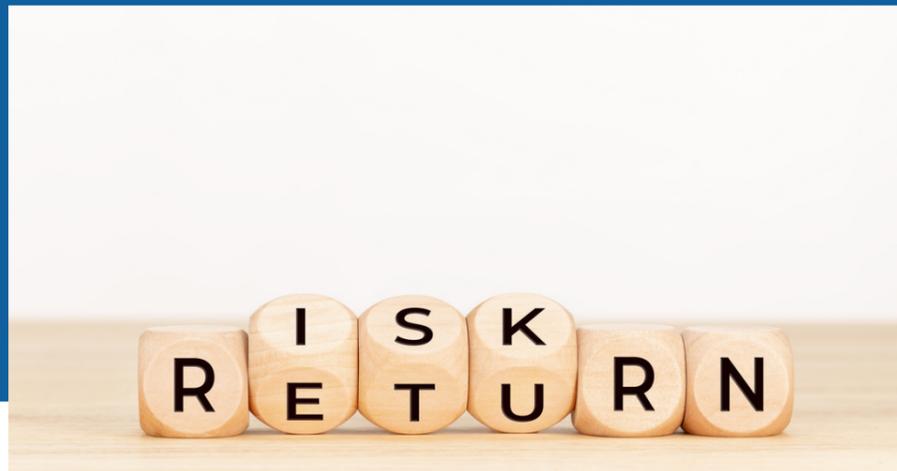
- Business, Economics, Mathematics and Statistics (minimum 54 ECTS or equivalent credit hours)
- Quantitative Analysis (e.g., Computer science, Programming, Econometrics, etc.)
- Law

Minimum GPA: 75/100

Minimum English Language Requirements:

- IELTS Academic 6.5 or higher
- TOEFL iBT 80 or higher
- Cambridge B2 First or higher
- TOEIC Listening & Reading 730 or higher

CURRICULUM FINANCIAL RISK AND DATA ANALYSIS: KSA MODEL



KNOWLEDGE

Mathematics, probability and statistics, financial time series, financial optimization, econometrics



SKILLS

Apply the most appropriate quantitative methods and the most suitable econometric techniques for risk assessment and risk management



ABILITIES

Work with data prediction methodologies, also in a multivariate framework to study and analyze dependencies



Jobs opportunities

- Data Analyst
- Business Analyst
- Risk manager





STEP FINALI



Incontri con le aziende

Il corso di laurea magistrale in Finanza e Assicurazioni prevede l'erogazione di seminari per completare il proprio percorso formativo. Tali seminari sono tenuti da docenti esterni e professionisti in ambiti specifici con l'intento di creare un ponte tra l'Accademia ed il mondo del lavoro.



Tesi di laurea magistrale FINASS

- La tesi di laurea magistrale Finass può essere di natura teorica, sperimentale e/o progettuale su un argomento specifico, legato a tematiche caratterizzanti il corso
- Il lavoro di tesi deve essere svolto in modo autonomo dallo studente, sotto la guida di un relatore (docente appartenente al CAD o da esso autorizzato)
- La prova finale viene assegnata allo studente e, successivamente, consegnata dal laureando e approvata dal relatore mediante apposita procedura telematica. Alla prova finale sono attribuiti 21 cfu



INTERNSHIP

- ✓ PRACTICE
- ✓ EXPERIENCE
- ✓ TRAINING
- ✓ SKILLS



TIROCINI IN AZIENDA



Gli studenti laureandi possono svolgere tirocini formativi presso imprese ed enti esterni per completare il proprio percorso di studi, anche attraverso l'elaborazione di una tesi di laurea magistrale associata ad un opportuno progetto formativo. Questa possibilità è resa possibile dall'Ateneo mediante la piattaforma JobSoul.

**Corso di Laurea
Magistrale
FINASS**

CODICE CORSO: 30414

FACOLTÀ: ECONOMIA

**DIPARTIMENTO: METODI E MODELLI PER
L'ECONOMIA, IL TERRITORIO, LA FINANZA**

DURATA: 2 ANNI

CLASSE DI LAUREA: LM-16

**MODALITÀ DI AMMISSIONE: VERIFICA DEI
REQUISITI E DELLA PREPARAZIONE
PERSONALE**

**PRESIDENTE DEL CORSO DI LAUREA:
PROF.SSA BARBARA VANTAGGI**