



Risk Management

MODULO 0 - INTRODUZIONE AL RISK MANAGEMENT

[Collapse all](#)

[🔗](#) [Lezione 1 - Cos'è e a cosa serve il Risk Management](#) [📝](#)

[PDF](#) [Lezione 1 - Cos'è e a cosa serve il Risk Management \(pdf\)](#) [📝](#)

[🔗](#) [Lezione 2 - Risk Management e Money Management](#) [📝](#)

[PDF](#) [Lezione 2 - Risk Management e Money Management \(pdf\)](#) [📝](#)

[🔗](#) [Lezione 3 - Struttura del corso e cosa imparerai](#) [📝](#)

[PDF](#) [Lezione 3 - Struttura del corso e cosa imparerai \(pdf\)](#) [📝](#)

MODULO 1 - UN RIPASSO DI STATISTICA

[🔗](#) [Lezione 1 - Le Medie](#) [📝](#)

[PDF](#) [Lezione 1 - Le Medie \(pdf\)](#) [📝](#)

[🔗](#) [Lezione 2 - Il Valore Atteso](#) [📝](#)

[PDF](#) [Lezione 2 - Il Valore Atteso \(pdf\)](#) [📝](#)

 [Lezione 3 - Volatilità e Varianza](#) 

 [Lezione 3 - Volatilità e Varianza \(pdf\)](#) 

 [Lezione 4 - La Covarianza](#) 

 [Lezione 4 - La Covarianza \(pdf\)](#) 

 [Lezione 5 - Le Variabili Casuali e Calcolo della Probabilità](#) 

 [Lezione 5 - Le Variabili Casuali e Calcolo della Probabilità \(pdf\)](#) 

 [Lezione 6 - Equivalento Certo, Avversione al Rischio e Funzioni di Utilità](#) 

 [Lezione 6 - Equivalento Certo, Avversione al Rischio e Funzioni di Utilità \(pdf\)](#) 

MODULO 2 - IL PROFILO DI RISCHIO

 [Lezione 1 - Avversione al Rischio](#) 

 [Lezione 1 - Avversione al Rischio \(pdf\)](#) 

 [Lezione 2 - Fattori che Influenzano il Profilo di Rischio](#) 

 [Lezione 2 - Fattori che Influenzano il Profilo di Rischio \(pdf\)](#) 

 [Lezione 3 - Determinare il Proprio Profilo di Rischio](#) 

 [Lezione 3 - Determinare il Profilo di Rischio \(pdf\)](#) 

 [Questionario Avversione Al Rischio - N°1](#) 

 [Questionario Avversione Al Rischio - N°2](#) 

 [Questionario Avversione Al Rischio - N°3](#) 

 [Calcolatore Punteggio Finale Profilo Di Rischio](#) 

 [Lezione 4 - Come il Profilo di Rischio Impatta sul Rendimento](#) 

 [Lezione 4 - Come il Profilo di Rischio Impatta sul Rendimento \(pdf\)](#) 

MODULO 3 - CRITERI DI SCELTA ED ANALISI DI PORTAFOGLI

 [Lezione 1 - Il Backtest](#) 

 [Lezione 1 - Il Backtest \(pdf\)](#) 

 [Lezione 2 - Le Unità come Indicatori di Redditività](#) 

 [Lezione 2 - Le Unità come Indicatori di Redditività \(pdf\)](#) 

 [Lezione 3 - Sharpe Ratio](#) 

 [Lezione 3 - Sharpe Ratio \(pdf\)](#) 

 [Lezione 4 - Criterio Media-Varianza](#) 

 [Lezione 4 - Criterio Media-Varianza \(pdf\)](#) 

 [Lezione 5 - Paradosso di San Pietroburgo e l'Utilità Attesa](#) 

 [Lezione 5 - Paradosso di San Pietroburgo e l'Utilità Attesa \(pdf\)](#) 

 [Lezione 6 - Return On Equity \(ROE\) e l'Effetto Leva](#) 

 [Lezione 6 - Return On Equity \(ROE\) e l'Effetto Leva \(pdf\)](#) 

 [Lezione 7 - Portafoglio Ottimo](#) 

 [Lezione 7 - Portafoglio Ottimo \(pdf\)](#) 

 [Lezione 8 - La Diversificazione : Minimizzazione del Rischio](#) 

 [Lezione 8 - La Diversificazione: Minimizzazione del Rischio \(pdf\)](#) 

MODULO 4 - LA STIMA DEL RISCHIO

 [Lezione 1 - I Drawdown: l'indicatore del Rischio di Mercato](#) 

 [Lezione 1 - I Drawdown: l'indicatore del Rischio di Mercato \(pdf\)](#) 

 [Lezione 2 - Value at Risk: Modello di stima del Rischio](#) 

 [Lezione 2 - Value at Risk: Modello di stima del Rischio \(pdf\)](#) 

 [Lezione 3 - Il Modello dell'Expected Shortfall](#) 

 [Lezione 3 - Il Modello dell'Expected Shortfall \(pdf\)](#) 

 [Lezione 4 - Risk of Ruin](#) 

⋮

 [Lezione 4 - Risk of Ruin](#) 

⋮

 [Lezione 5 - Valutazione del Rischio ed Analisi](#) 

⋮

 [Lezione 5 - Valutazione del Rischio ed Analisi \(pdf\)](#) 

⋮

 [DataRisk 1.0](#)  XLSX

⋮

MODULO 5 - UNA PASSEGGIATA PER MONTECARLO

⋮

 [Lezione 1 - Simulazione Montecarlo](#) 

⋮

 [Lezione 1 - Simulazione Montecarlo](#) 

⋮

 [Lezione 2 - Simulazione Montecarlo nel DataRisk](#) 

⋮

 [Lezione 2 - Simulazione Montecarlo nel DataRisk](#) 

⋮

SEZIONE 2 - DETERMINARE IL MONEY MANAGEMENT (in produzione)

⋮