

**CORSO DI STUDIO ESMI**

**ANNO ACCADEMICO 2023-2024**

**DENOMINAZIONE DELL'INSEGNAMENTO** *Econometria Finanziaria – Financial Econometrics*

Principali informazioni sull'insegnamento	
Anno di corso	II
Periodo di erogazione	II semestre
Crediti formativi universitari (CFU/ETCS):	6 CFU
SSD	SECS P05
Lingua di erogazione	Italiano
Modalità di frequenza	Facoltativa

Docente	
Nome e cognome	Stefania Basiglio
Indirizzo mail	<a href="mailto:stefania.basiglio@uniba.it">stefania.basiglio@uniba.it</a>
Telefono	-
Sede	Dipartimento di Economia e Finanza Piano 2 – Stanza Area Geografia Economica
Sede virtuale	-
Ricevimento	Martedì 14-16 (previo appuntamento tramite mail)

Organizzazione della didattica			
Ore			
Totali	Didattica frontale	Pratica (laboratorio, campo, esercitazione, altro)	Studio individuale
150	42		108
CFU/ETCS			
6			

<b>Obiettivi formativi</b>	<i>Il corso si propone di fornire un'introduzione all'econometria analizzando dunque i principali modelli econometrici fondamentali per l'analisi di effetti causali tra variabili economiche</i>
<b>Prerequisiti</b>	<i>Elementi di base di inferenza, probabilità statistica e algebra matriciale</i>

<b>Metodi didattici</b>	<i>Lezioni frontali e esercitazioni (tramite software informatici quali R e/o Gretl)</i>
-------------------------	--

<b>Risultati di apprendimento previsti</b>  <i>Da indicare per ciascun Descrittore di Dublino (DD=</i>  <b>DD1</b> <i>Conoscenza e capacità di comprensione</i>  <b>DD2</b> <i>Conoscenza e capacità di</i>	<i>Al termine del corso, ci si attende che lo/a studente/ssa</i> <ul style="list-style-type: none"> <li><i>abbia una conoscenza approfondita di notazioni e concetti utilizzati in econometria;</i></li> <li><i>sia in grado di leggere e comprendere articoli inerenti alla ricerca economica;</i></li> <li><i>sia in grado di interpretare e comprendere i risultati di analisi prodotte da altri e sia in grado di svolgere le proprie.</i></li> </ul> <ul style="list-style-type: none"> <li><i>Conoscenza e capacità di comprensione</i> <i>Comprensione dei metodi di analisi econometrica; conoscenza dei metodi di stima delle funzioni lineari e non lineari</i></li> <li><i>Conoscenza e capacità di comprensione applicate</i> <i>Padronanza della strumentazione analitica e concettuale di base</i></li> </ul>
---	---

<b>comprensione applicate</b> <b>DD3-5 Competenze trasversali</b>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• <i>Autonomia di giudizio</i></li> </ul> <i>Capacità di analizzare e di interpretazione i dati economici e finanziari</i>
<b>Contenuti di insegnamento (Programma)</b>	<i>L'analisi statistica delle relazioni economiche e finanziarie.</i> <i>Le fasi della costruzione del modello econometrico</i> <i>Il modello di regressione lineare.</i> <i>La stima del modello di regressione lineare: modello lineare classico e modello lineare generalizzato.</i> <i>Applicazioni in ambito finanziario.</i> <i>Introduzione all'analisi diagnostica.</i> <i>Analisi delle serie storiche.</i>
<b>Testi di riferimento</b>	<i>Stock, J.H., Watson, M.W., Introduzione all'Econometria 5/Ed, Pearson.</i> <i>Verbeek, M. (2000), Modern Econometrics, Wiley.</i> <i>Gardini, A., Fanelli, L., Cavaliere, G., Costa, M, Econometria, Vol 1°, Franco Angeli Editore Milano.</i> <i>Campbell, J.Y., Lo, A.W., MacKinlay, A. C. (1997), The Econometrics of Financial Markets, Princeton University Press, Princeton.</i> <i>Sergio Pastorello, Rischio e rendimento. Teoria finanziaria e applicazioni econometriche, il Mulino, 2001.</i>
<b>Note ai testi di riferimento</b>	-
<b>Materiali didattici</b>	<i>Moodle e/o sito web personale</i>

<b>Valutazione</b>	
Modalità di verifica dell'apprendimento	<i>Prova scritta con domande aperte.</i> <i>Se possibile, si prevede lo svolgimento di un breve esercizio bonus da svolgere su R con possibilità di guadagnare fino a 3 punti bonus (validi per l'a.a. 23/24) in aggiunta al voto ottenuto in sede d'esame.</i> <i>L'iscrizione tramite il sistema Esse3 è d'obbligo e non verranno ammessi eventuali studenti/esse non regolarmente iscritti/e all'appello.</i>
Criteri di valutazione	<i>Al termine del corso, lo/a studente/ssa dovrà</i> <ul style="list-style-type: none"> <li>• <i>dimostrare una conoscenza approfondita di notazioni e concetti utilizzati in econometria;</i></li> <li>• <i>essere in grado di leggere e comprendere articoli inerenti alla ricerca economica;</i></li> <li>• <i>essere in grado di interpretare e comprendere i risultati di analisi prodotte da altri e sia in grado di svolgere le proprie.</i></li> </ul>
Criteri di misurazione dell'apprendimento e di attribuzione del voto finale	<i>Il voto finale è attribuito in trentesimi. L'esame si intende superato quando il voto è maggiore o uguale a 18.</i> <i>Se possibile, si prevede lo svolgimento di un breve esercizio bonus da svolgere su R con possibilità di guadagnare fino a 3 punti bonus (validi per l'a.a. 23/24) in aggiunta al voto ottenuto in sede d'esame.</i>
<b>Altro</b>	