

| | |
|--|-------------------------|
| Principali informazioni sull'insegnamento | |
| Titolo insegnamento | Econometria Finanziaria |
| Corso di studio | EFI |
| Crediti formativi | 8 CFU |
| Denominazione inglese | Financial Econometrics |
| Obbligo di frequenza | No |
| Lingua di erogazione | Italiano |

| | | |
|-----------------------------|----------------|--|
| Docente responsabile | Nome Cognome | Indirizzo Mail |
| | Laura Serlenga | laura.serlenga@uniba.it |

| | | | |
|----------------------------------|---------------------|----------|---------|
| Dettaglio credi formativi | Ambito disciplinare | SSD | Crediti |
| | Economia | SECS P05 | 8 |

| | |
|-------------------------------|-----------------------------------|
| Modalità di erogazione | |
| Periodo di erogazione | Semestre II |
| Anno di corso | II |
| Modalità di erogazione | Lezioni frontali Esercitazioni |

| | |
|---------------------------------------|----|
| Organizzazione della didattica | |
| Ore totali | 56 |
| Ore di corso | |
| Ore di studio individuale | |

| | |
|----------------------------|------------------|
| Calendario | |
| Inizio attività didattiche | 18 febbraio 2019 |
| Fine attività didattiche | |

| | |
|--|---|
| Syllabus | |
| Prerequisiti | Elementi di base di inferenza, probabilità statistica e algebra matriciale |
| Risultati di apprendimento previsti (declinare rispetto ai Descrittori di Dublino) (si raccomanda che siano coerenti con i risultati di apprendimento del CdS, riportati nei quadri A4a, A4b e A4c della SUA, compreso i risultati di apprendimento trasversali) | <ul style="list-style-type: none"> • <i>Conoscenza e capacità di comprensione</i> <p>Comprensione dei metodi di analisi econometrica; conoscenza dei metodi di stima delle funzioni lineari e non lineari</p> <ul style="list-style-type: none"> • <i>Conoscenza e capacità di comprensione applicate</i> <p>Padronanza della strumentazione analitica e concettuale di base</p> <ul style="list-style-type: none"> • <i>Autonomia di giudizio</i> <p>Capacità di analizzare e di interpretazione i dati economici e</p> |

| | |
|---------------------------|---|
| | finanziari |
| Contenuti di insegnamento | <p>PARTE PRIMA: ANALISI DELLE RELAZIONI ECONOMICHE E FINANZIARIE</p> <p>L'analisi statistica delle relazioni economiche.</p> <p>Le fasi della costruzione del modello econometrico il modello di regressione lineare.</p> <p>La stima del modello di regressione lineare: modello lineare classico e modello lineare generalizzato.</p> <p>Applicazioni in ambito finanziario.</p> <p>Introduzione all'analisi diagnostica.</p> <p>PARTE SECONDA:</p> <p>Il modello CAPM: specificazione, analisi, stima e utilizzo</p> <p>L'analisi event-study nei mercati finanziari.</p> <p>PARTE TERZA: INTRODUZIONE AI MODELLI PER LA VOLATILITA' CONDIZIONALE</p> <p>Modelli per la volatilità condizionale.</p> <p>Misure per il rischio</p> <p>Introduzione ai modelli ARCH e loro utilizzo in finanza.</p> <p>Generalizzazione: modelli GARCH.</p> <p>Stima di massima verosimiglianza.</p> |

| | |
|---|---|
| Programma | |
| Testi di riferimento | <p>Verbeek, M. (2000), Modern Econometrics, Wiley.</p> <p>Attilio Gardini, Luca Fanelli, Giuseppe Cavaliere, Michele Costa, ECONOMETRIA, Vol 1°, Franco Angeli Editore Milano.</p> <p>Campbell, J.Y., Lo, A.W., MacKinlay, A. C. (1997), The Econometrics of Financial Markets, Princeton University Press, Princeton.</p> <p>Sergio Pastorello, Rischio e rendimento. Teoria finanziaria e applicazioni econometriche, il Mulino, 2001</p> |
| Note ai testi di riferimento | |
| Metodi didattici | |
| Metodi di valutazione (indicare almeno la tipologia scritto, orale, altro) | Prova scritta |
| Criteri di valutazione (per ogni risultato di apprendimento atteso su indicato, descrivere cosa ci si aspetta lo studente conosca o sia in grado di fare e a quale livello al fine di dimostrare che un risultato di apprendimento è stato raggiunto e a quale livello) | |

| | |
|-------|--|
| Altro | |
| | |