

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	I semestre
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>L'analisi statistica delle relazioni economiche e finanziarie.</p> <p>Le fasi della costruzione del modello econometrico</p> <p>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>Analisi delle serie storiche</p>

Programma	
Testi di riferimento	<p>Verbeek, M. (2000), <i>Modern Econometrics</i>, Wiley.</p> <p>Attilio Gardini, Luca Fanelli, Giuseppe Cavaliere, Michele Costa, <i>ECONOMETRIA</i>, Vol 1°, Franco Angeli Editore Milano.</p> <p>Campbell, J.Y., Lo, A.W., MacKinlay, A. C. (1997), <i>The Econometrics of Financial Markets</i>, Princeton University Press, Princeton.</p> <p>Sergio Pastorello, <i>Rischio e rendimento. Teoria finanziaria e applicazioni econometriche</i>, 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	