

CORSO DI STUDIO *EFI*
ANNO ACCADEMICO 2023-2024
DENOMINAZIONE DELL'INSEGNAMENTO *Econometria Finanziaria – Financial Econometrics*

Principali informazioni sull'insegnamento	
Anno di corso	<i>II</i>
Periodo di erogazione	<i>II semestre</i>
Crediti formativi universitari (CFU/ETCS):	<i>8 CFU</i>
SSD	<i>SECS P05</i>
Lingua di erogazione	<i>Italiano</i>
Modalità di frequenza	<i>Facoltativa</i>

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

Organizzazione della didattica			
Ore			
Totali	Didattica frontale	Pratica (laboratorio, campo, esercitazione, altro)	Studio individuale
<i>200</i>	<i>56</i>		<i>144</i>
CFU/ETCS			
<i>8</i>			

Obiettivi formativi	<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>
Prerequisiti	<i>Elementi di base di inferenza, probabilità statistica e algebra matriciale</i>

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

Risultati di apprendimento previsti <i>Da indicare per ciascun Descrittore di Dublino (DD=</i> <i>DD1 Conoscenza e capacità di comprensione</i> <i>DD2 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"> • <i>abbia una conoscenza approfondita di notazioni e concetti utilizzati in econometria;</i> • <i>sia in grado di leggere e comprendere articoli inerenti alla ricerca economica;</i> • <i>sia in grado di interpretare e comprendere i risultati di analisi prodotte da altri e sia in grado di svolgere le proprie.</i> <ul style="list-style-type: none"> • <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> • <i>Conoscenza e capacità di comprensione applicate</i> <i>Padronanza della strumentazione analitica e concettuale di base</i>
---	---

comprensione applicate DD3-5 Competenze trasversali	<ul style="list-style-type: none"> • <i>Autonomia di giudizio</i> <i>Capacità di analizzare e di interpretazione i dati economici e finanziari</i>
Contenuti di insegnamento (Programma)	<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>
Testi di riferimento	<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>
Note ai testi di riferimento	-
Materiali didattici	<i>Moodle e/o sito web personale</i>

Valutazione	
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"> • <i>dimostrare una conoscenza approfondita di notazioni e concetti utilizzati in econometria;</i> • <i>essere in grado di leggere e comprendere articoli inerenti alla ricerca economica;</i> • <i>essere in grado di interpretare e comprendere i risultati di analisi prodotte da altri e sia in grado di svolgere le proprie.</i>
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>
Altro	