

CORSO DI STUDIO: Statistica e Metodi per l'Economia e la Finanza
ANNO ACCADEMICO: 2023-2024
DENOMINAZIONE DELL'INSEGNAMENTO : Modelli previsivi

Principali informazioni sull'insegnamento	
Anno di corso	Il anno
Periodo di erogazione	I semestre
Crediti formativi universitari (CFU/ETCS):	8
SSD	SECS-S/03
Lingua di erogazione	Italiano
Modalità di frequenza	La frequenza non è obbligatoria ma è fortemente consigliata

Docente	
Nome e cognome	Vittorio Nicolardi
Indirizzo mail	vittorio.nicolardi@uniba.it
Telefono	+390805049201
Sede	Dipartimento di Economia e Finanza
Sede virtuale	https://www.uniba.it/it/docenti/nicolardi-vittorio
Ricevimento	Mercoledì 9:30 – 13:30

Organizzazione della didattica			
Ore			
Totali	Didattica in presenza	Pratica (laboratorio, campo, esercitazione, altro)	Studio individuale
200	35	21	150
CFU/ETCS			
8	5	3	

Obiettivi formativi	
Prerequisiti	<i>Lo studente deve possedere adeguate conoscenze di base di statistica metodologica multivariata, dieconometria e di economia.</i>

Metodi didattici	
	<ul style="list-style-type: none"> - <i>Lezioni frontali riguardanti gli argomenti teorici del corso, con riferimenti e analisi relativi ai fenomeni finanziari sia a livello microeconomico, sia a livello macroeconomico.</i> - <i>Esercitazioni con software econometrico GRETL utilizzando le banche dati economiche online nazionali (ISTAT) ed europee (EUROSTAT).</i>

Risultati di apprendimento previsti	
DD1 Conoscenza e capacità di comprensione	<p><i>Lo studente/studentessa sarà in grado di:</i></p> <ul style="list-style-type: none"> - <i>utilizzare le competenze metodologiche acquisite per identificare definire la struttura dei mercati finanziari;</i> - <i>effettuare previsioni di scenario in relazione all'evoluzione delle variabili finanziarie in diversi campi applicativi.</i>
DD2 Conoscenza e capacità di comprensione applicate	<p><i>Lo studente/studentessa sarà in grado di:</i></p> <ul style="list-style-type: none"> - <i>applicare le conoscenze acquisite agli specifici casi concreti che si presentano sui mercati finanziari, sia relativamente all'ambito pubblico, sia</i>

<p>DD3-5 Competenze trasversali</p>	<p><i>relativamente all'ambito privatistico.</i></p> <ul style="list-style-type: none"> - <i>interpretazione i fenomeni economici legati alle scelte finanziarie individuali e alle scelte finanziarie collettive.</i> <p><i>Il corso si pone l'obiettivo di dotare gli studenti di strumenti che consentano loro di:</i></p> <ul style="list-style-type: none"> - <i>sviluppare con senso critico e oggettivo una capacità di analisi esaustiva dei fenomeni finanziari;</i> - <i>essere in grado di interpretare e comunicare i risultati delle analisi agli interlocutori esterni relativamente alle decisioni e agli interventi strutturali e congiunturali in ambito economico e finanziario;</i> - <i>comprendere la natura dei fenomeni studiati e sviluppare la capacità di applicare coerentemente le corrette metodologie necessarie alla comprensione dei fenomeni stessi.</i>
<p>Contenuti di insegnamento (Programma)</p>	<p><i>Parte I: I modelli econometrici.</i></p> <ul style="list-style-type: none"> - <i>Teoria economica, dati statistici e modelli econometrici;</i> - <i>L'informazione temporale;</i> - <i>Operatore ritardo;</i> - <i>Stazionarietà; memoria ed ergodicità;</i> - <i>Previsioni, innovazioni e proiezioni lineari;</i> - <i>I processi non stazionari per la media e per la varianza;</i> <p><i>Parte II: I modelli econometrici dinamici.</i></p> <ul style="list-style-type: none"> - <i>I modelli econometrici dinamici: concetti e definizioni;</i> - <i>Esogeneità, causalità, identificazione e specificazione nei modelli econometrici;</i> - <i>Analisi di specificazione e validazione dei modelli econometrici;</i> - <i>Il modello dinamico di regressione multivariata.</i> <p><i>Parte III: Sistemi di equazioni simultanee.</i></p> <ul style="list-style-type: none"> - <i>I sistemi di equazioni simultanee. forma strutturale e forma ridotta;</i> - <i>Il problema dell'identificazione nei sistemi di equazioni simultanee;</i> - <i>Sistemi di equazioni simultanee: modelli VAR e VARMA;</i> - <i>La stima dei sistemi di equazioni simultanee: forma ridotta e forma strutturale;</i> - <i>Variabili strumentali;</i> - <i>Metodi di stima a informazione limitata e completa;</i> - <i>Test dei vincoli di sovraidentificazione.</i>
<p>Testi di riferimento</p>	<ul style="list-style-type: none"> - <i>Gardini A., Cavaliere G., Costa M., Fanelli L., Paruolo P. - Econometria. Volume I, Franco Angeli Editore, Milano 2014 (Capp. 1 e 5).</i> - <i>Gardini A., Cavaliere G., Costa M., Fanelli L., Paruolo P. - Econometria. Volume II, Franco Angeli Editore, Milano 2011 (Capp. 6 e 8 – escluso: VAR di cointegrazione in 8.3.1, par. 8.5).</i> - <i>Dispense del docente</i>
<p>Note ai testi di riferimento</p>	
<p>Materiali didattici</p>	<p><i>Le dispense e il materiale d'esercitazione viene reso disponibile dal docente in formato elettronico.</i></p>

<p>Valutazione</p>	
<p>Modalità di verifica dell'apprendimento</p>	<p><i>L'accertamento delle conoscenze dello studente/studentessa avviene esclusivamente attraverso una prova orale, durante la quale sono valutate le conoscenze teoriche sulle tematiche del corso, nonché la capacità di valutare le implicazioni delle suddette conoscenze sulla valutazione economica di titoli finanziari, sulla scorta delle analisi effettuate durante le lezioni frontali e le esercitazioni in aula.</i></p>
<p>Criteri di valutazione</p>	<p><i>Lo studente/studentessa dovrà mostrare una buona conoscenza degli argomenti affrontati nello svolgimento del corso e una relativa buona capacità espositiva degli stessi, utilizzando in maniera opportuna il lessico specialistico. Inoltre, dovrà</i></p>

	<i>mostrare capacità di ragionamento critico sullo studio realizzato.</i>
Criteria di misurazione dell'apprendimento e di attribuzione del voto finale	<i>Il voto finale è attribuito in trentesimi e l'esame si intende superato quando il voto è maggiore o uguale a 18.</i>
Altro	