

Syllabus

Descrizione corso

Titolo insegnamento	Econometria per la Finanza
Codice insegnamento	27348
Titolo aggiuntivo	
Settore Scientifico-Disciplinare	ECON-05/A
Lingua	Italiano
Corso di Studio	Corso di laurea in Economia e Management
Altri Corsi di Studio (mutuati)	
Docenti	dr. Greta Goracci, Greta.Goracci@unibz.it https://www.unibz.it/en/faculties/economics-management/academic-staff/person/46136
Assistante	
Semestre	Secondo semestre
Anno/i di corso	3
CFU	6
Ore didattica frontale	36
Ore di laboratorio	18
Ore di studio individuale	-
Ore di ricevimento previste	18
Sintesi contenuti	<p>Il corso affronta diversi argomenti legati alla modellazione e all'analisi delle serie temporali, con l'obiettivo di studiare e interpretare i fenomeni economici e finanziari.</p> <p>È strutturato su tre aree principali:</p> <ul style="list-style-type: none">(1) il modello di regressione lineare(2) i modelli ARIMA; e(3) i modelli per l'analisi della volatilità. <p>Ogni argomento è presentato in modo approfondito da un punto di vista</p>

	<p>teorica e vengono discusse le principali applicazioni pratiche. Il corso include esercizi guidati per supportare la comprensione dei concetti chiave, nonché l'analisi pratica di serie di dati reali utilizzando il software R.</p>
Argomenti dell'insegnamento	<ol style="list-style-type: none"> 1. Il modello di regressione lineare <ul style="list-style-type: none"> • Regressione lineare semplice/multipla • Stima ed inferenza sui parametri di regressione • Bontà di adattamento e multicollinearità • Analisi dei residui e diagnostica 2. Modelli ARIMA <ul style="list-style-type: none"> • modello AR • modello MA • modello ARMA • Previsione 3. Modelli GARCH <ul style="list-style-type: none"> • analisi della volatilità • Test per effetti ARCH • modelli ARCH/GARCH
Parole chiave	Regressione lineare; analisi delle serie storiche; volatilità
Prerequisiti	Probabilità e statistica
Insegnamenti propedeutici	
Modalità di insegnamento	Lezioni frontali ed esercitazioni
Obbligo di frequenza	Non obbligo di frequenza, tuttavia frequenza consigliata
Obiettivi formativi specifici e risultati di apprendimento attesi	<p>ILO (Intended Learning Outcomes)</p> <p>ILO 1 Conoscenza e comprensione</p> <p>ILO 1.1 conoscenza degli strumenti matematici di livello base ed intermedio per la comprensione e l'analisi dei meccanismi economici attraverso modelli teorici ed applicazioni empiriche</p> <p>ILO 1.2 conoscenza degli strumenti per l'analisi statica, dinamica, e quella comparativa per l'analisi dei dati su individui, imprese ed economie</p> <p>ILO 1.3 conoscenza e comprensione della statistica descrittiva, dei fondamenti della teoria della probabilità e dei metodi a campione, delle distribuzioni standard e della loro applicazione all'analisi economica nonché della regressione lineare e non lineare</p>

	<p>ILO 2 Capacità di applicare conoscenza e comprensione</p> <p>ILO 2.1 saper analizzare dati economici usando metodi della statica descrittiva, parametrica e non parametrica nonché regressione lineare e non lineare e interpretare i risultati</p> <p>ILO 2.2 saper stabilire l'impostazione e lo svolgimento di un progetto empirico con l'utilizzo di un software econometrico e di base dati finanziari o economici</p> <p>ILO 2.3 saper utilizzare gli strumenti informatici per le analisi delle economie</p> <p>ILO 3 Autonomia di giudizio</p> <p>ILO 3.1 scegliere i più appropriati metodi di analisi sia quantitativi che qualitativi</p> <p>ILO 3.2 trovare le informazioni necessarie in banche dati, fonti giuridiche e letteratura scientifica</p> <p>ILO 3.3 utilizzare il ragionamento logico per combinare informazione e metodi analitici, anche tramite moderni pacchetti software, per arrivare ad una soluzione</p> <p>ILO 4 Capacità di apprendimento</p> <p>ILO 4.1 reperire informazioni da banche dati, letteratura scientifica, leggi e normativa come richiesto nella vita professionale</p> <p>ILO 4.2 analizzare, elaborare criticamente ed integrare dati, informazioni ed esperienze future, anche tramite software avanzati</p>
Obiettivi formativi specifici e risultati di apprendimento attesi (ulteriori info.)	<p>Conoscenza e comprensione:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Conoscenza avanzata e comprensione dei metodi econometrici correlati ai tipi comuni di dati finanziari e aziendali. <p>Applicazione della conoscenza e comprensione:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Capacità di applicare metodi econometrici a veri tipi di dati finanziari utilizzando software specifici. • Capacità di interpretare i risultati delle analisi nel contesto di problemi finanziari e aziendali comuni. <p>Formulazione di giudizi:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Capacità di pensare in modo critico e prendere decisioni efficaci basate su analisi econometriche appropriate.

	<p>Abilità comunicative:</p> <ul style="list-style-type: none">• Capacità di comunicare efficacemente i risultati delle analisi econometriche, anche ad un pubblico non specializzato.
Modalità di esame	(60% del voto finale della materia): Esame finale scritto (40% del voto finale della materia): Progetto di gruppo: analisi di un data-set reale tramite il software R ILO valutati da 1 a 4
Criteri di valutazione	Esame finale scritto: 60% Progetto: 40% Gli studenti devono superare l'esame finale (ossia rispondere correttamente ad almeno il 60% delle domande nell'esame) per ottenere un voto positivo nel corso.
Bibliografia obbligatoria	Jim H. Stock and Mark W. Watson, Introduction to Econometrics, Pearson International 4th Edition.
Bibliografia facoltativa	--
Altre informazioni	--
Obiettivi di Sviluppo Sostenibile (SDGs)	Parità di genere, Istruzione di qualità