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 prof. Francesco Ravazzolo, Francesco.Ravazzolo@unibz.it https://www.unibz.it/en/faculties/economics-management/academic-staff/person/36066 dr. Sara Casagrande, Sara.Casagrande2@unibz.it https://www.unibz.it/en/faculties/economics-management/academic-staff/person/52142
Assistente	
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	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. È strutturato su tre aree principali: (1) il modello di regressione lineare (2) i modelli ARIMA; e (3) i modelli per l'analisi della volatilità. Ogni argomento è presentato in modo approfondito da un punto di vista 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.
Argomenti dell'insegnamento	1. Il modello di regressione lineare • Regressione lineare semplice/multipla • Stima ed inferenza sui parametri di regressione • Bontà di adattamento e multicollinearità • Analisi dei residui e diagnostica 2. Modelli ARIMA • modello AR • modello MA • modello ARMA • Previsione 3. Modelli GARCH • 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	ILO (Intended Learning Outcomes) ILO 1 Conoscenza e comprensione 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

	ILO 1.2 conoscenza degli strumenti per l'analisi statica, dinamica, e quella comparativa per l'analisi dei dati su individui, imprese ed economie 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 ILO 2 Capacità di applicare conoscenza e comprensione 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 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 ILO 2.3 saper utilizzare gli strumenti informatici per le analisi delle economie ILO 3 Autonomia di giudizio ILO 3.1 scegliere i più appropriati metodi di analisi sia quantitativi che qualitativi ILO 3.2 trovare le informazioni necessarie in banche dati, fonti giuridiche e letteratura scientifica ILO 3.3 utilizzare il ragionamento logico per combinare informazione e metodi analitici, anche tramite moderni pacchetti software, per arrivare ad una soluzione ILO 4 Capacità di apprendimento ILO 4.1 reperire informazioni da banche dati, letteratura scientifica, leggi e normativa come richiesto nella vita professionale ILO 4.2 analizzare, elaborare criticamente ed integrare dati, informazioni ed esperienze future, anche tramite software avanzati
Obiettivi formativi specifici e risultati di apprendimento attesi (ulteriori info.)	Conoscenza e comprensione: • Conoscenza avanzata e comprensione dei metodi econometrici correlati ai tipi comuni di dati finanziari e aziendali. Applicazione della conoscenza e comprensione:

	• 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. Formulazione di giudizi: • Capacità di pensare in modo critico e prendere decisioni efficaci basate su analisi econometriche appropriate. Abilità comunicative: • 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