

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>Conoscenza e comprensione</p> <p>Area: Metodi quantitativi per il processo decisionale</p> <p>Padronanza degli strumenti matematici di base e intermedi per la comprensione e l'analisi dei meccanismi economici attraverso modelli teorici e applicazioni empiriche.</p> <p>Conoscenza degli strumenti per l'analisi statica, dinamica e comparativa dei dati relativi agli individui, alle imprese e all'economia</p> <p>Conoscenza e comprensione della statistica descrittiva, delle basi della teoria della probabilità e dei metodi di campionamento, delle distribuzioni standard e della loro applicazione alle analisi economiche, nonché della regressione lineare e non lineare.</p> <p>Conoscenza della stima parametrica e dei test di ipotesi</p> <p>Conoscenza degli strumenti informatici necessari per la lettura e l'analisi di dati e modelli economici.</p>

	<p>Conoscenza della struttura delle reti informatiche, delle loro applicazioni più importanti e delle tecniche di sicurezza, nonché delle tecniche di raccolta, visualizzazione e analisi dei dati con l'ausilio di software adeguati.</p> <p>Conoscenza dei sistemi contabili internazionali e della contabilità a doppia entrata per la registrazione e la valutazione delle transazioni commerciali.</p> <p>Comprensione dei bilanci annuali</p> <p>Conoscenza approfondita della raccolta dei dati contabili o del controllo di gestione</p> <p>Conoscenza del metodo di analisi per la stima dei valori attuali e dei fattori di sconto per la stima del costo del capitale e la valutazione di obbligazioni e azioni.</p> <p>Conoscenza dei metodi di previsione finanziaria a medio e lungo termine e dell'analisi di sensitività con simulazione in condizioni di incertezza per la gestione del rischio nell'area della finanza aziendale e internazionale.</p> <p>Conoscenza e comprensione del contesto finanziario internazionale, delle tecniche di difesa dal rischio multinazionale e delle strategie competitive delle banche globali.</p> <p>Conoscenza dei meccanismi alla base di una comunicazione efficace di argomenti quantitativi in tre lingue: Italiano, Tedesco e Inglese</p> <p>Capacità di applicare conoscenza e comprensione</p> <p>Area: Metodi quantitativi per il processo decisionale</p> <p>Capacità di analizzare problemi di ottimizzazione (non vincolata) e di interpretare matematicamente modelli di dinamiche sociali ed economiche</p> <p>essere in grado di formalizzare e risolvere problemi economici utilizzando modelli matematici e di interpretarne concettualmente i risultati</p> <p>essere in grado di analizzare dati economici utilizzando metodi di statistica descrittiva, parametrica e non parametrica, nonché di regressione lineare e non lineare e di interpretarne i risultati</p> <p>essere in grado di applicare i principi contabili internazionali ai vari contesti della realtà aziendale</p> <p>saper ricavare e interpretare informazioni economiche da Internet</p> <p>saper utilizzare il computer e le reti informatiche per analizzare grandi quantità di dati per risolvere problemi complessi e per</p>
--	--

	<p>scrivere tesi di laurea e articoli</p> <p>saper utilizzare programmi di foglio elettronico per valutare strumenti finanziari a tasso fisso e azioni di società quotate in borsa</p> <p>essere in grado di analizzare i bilanci utilizzando gli indici finanziari e di comunicare i risultati secondo gli standard professionali internazionali</p> <p>essere in grado di applicare le più importanti teorie sui mercati dei capitali, dei cambi e delle materie prime ai dati osservativi correnti, compresi quelli internazionali</p> <p>Conoscenza di come impostare e realizzare un progetto empirico utilizzando software econometrici e banche dati finanziarie o economiche</p> <p>essere in grado di applicare tecniche per valutare la performance delle attività finanziarie e comprendere i meccanismi di determinazione del prezzo delle attività finanziarie rischiose e dei tassi di interesse a pronti e a termine</p> <p>Capacità di utilizzare strumenti matematici e statistici di base e intermedi per studiare il comportamento degli agenti economici da una prospettiva teorica ed empirica.</p> <p>Conoscenza dell'analisi dei dati economici con l'utilizzo di fogli di calcolo o di altri software adeguati.</p> <p>conoscenza dell'uso di strumenti informatici per l'analisi delle economie</p> <p>essere in grado di comunicare i risultati delle analisi quantitative effettuate secondo gli standard professionali internazionali in tre lingue: Italiano, Tedesco e Inglese</p> <p>Autonomia di giudizio</p> <p>scegliere i più appropriati metodi di analisi sia quantitativi che qualitativi</p> <p>trovare le informazioni necessarie in banche dati, fonti giuridiche e letteratura scientifica</p> <p>utilizzare il ragionamento logico per combinare informazione e metodi analitici, anche tramite moderni pacchetti software, per arrivare ad una soluzione.</p> <p>Capacità di apprendimento</p> <p>reperire informazioni da banche dati, letteratura scientifica, leggi e normativa come richiesto nella vita professionale</p>
--	--

	analizzare, elaborare criticamente ed integrare dati, informazioni ed esperienze future, anche tramite software avanzati
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
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, <i>Introduction to Econometrics</i> , Pearson International 4th Edition.
Bibliografia facoltativa	--
Altre informazioni	--
Obiettivi di Sviluppo Sostenibile (SDGs)	Parità di genere, Istruzione di qualità