

Elementi di Econometria Finanziaria

Febbraio 2025

Andrea Monticini

Obiettivo del corso e risultati di apprendimento attesi

L'obiettivo del corso è di fornire le conoscenze pratiche per l'applicazione dei moderni strumenti econometrici utilizzati in ambito finanziario. Al termine del corso, gli studenti hanno a disposizione le conoscenze per poter redigere un'analisi empirica in modo autonomo, utilizzando un software econometrico. Gli studenti hanno le competenze per poter essere inseriti in profili lavorativi, nell'industria finanziaria nazionale ed internazionale, in cui sono richieste conoscenze quantitative.

- 1) Come utilizzare i dati finanziari
- 2) La correlazione
- 3) Modello di regressione lineare classico
- 4) Aspetti statistici del modello di regressione
- 5) Modello di regressione lineare multipla
- 6) Regressione con variabili dummy
- 7) Regressioni con variabili ritardate
- 8) Modelli per serie storiche
- 9) Regressioni con variabili in forma di serie storiche
- 10) Modelli per serie storiche multivariate
- 11) Modelli per descrivere la volatilità (G)ARCH
- 12) Metodi di simulazione

Orario delle lezioni.

Il corso è offerto nei mesi di Febbraio, Marzo e Aprile 2025, le lezioni si svolgono con il seguente orario:

- Venerdì 08:30 - 11:30

Bibliografia

Testo di riferimento è

- Analysis of Financial Data, G. Koop, Wiley, 2006

Didattica del corso

Tutti gli argomenti teorici trattati saranno accompagnati da corrispondenti verifiche empiriche svolte in aula.

Metodo di valutazione

L'esame si svolge in forma di test, utilizzando la piattaforma blackboard. Il giorno dell'esame lo studente deve portare il proprio pc portatile in aula. Il pc portatile deve avere un'autonomia di 60 minuti e deve essere in grado di connettersi alla rete wifi di Ateneo. Il test si compone di tre parti: la prima parte è composta da sei domande di tipo Vero o Falso. La seconda parte è composta da sei domande di tipo scelta multipla, in cui solo una è la risposta esatta. La terza parte si basa su sei domande in cui si chiede di analizzare il risultato della stima di un modello empirico. Il voto finale è calcolato utilizzando una media ponderata: la prima parte vale sei punti, la seconda parte vale sei punti, la terza parte vale 18 punti. Per gli studenti frequentanti, in aggiunta al test descritto in precedenza, è prevista la possibilità, a scelta dello studente, di consegnare entro la fine del corso un'analisi empirica in forma scritta, svolta in modo autonomo. In questo caso, cioè se lo studente decide di consegnare l'analisi empirica, **solo** per l'appello immediatamente successivo alla fine del corso, il test finale si compone delle prime due parti: la prova empirica **sostituisce** la terza parte.

Web page

La pagina web del corso è <http://monticini.eu/teaching/eef/>