

Syllabus Attività Formativa

Anno Offerta	2017
Corso di Studio	LM19F - ECONOMIA E FINANZA
Regolamento Didattico	LM19F-17
Percorso di Studio	19FLM1B - BANCHE E INTERMEDIARI FINANZIARI
Insegnamento/Modulo	M242 - ECONOMETRIA PER LA FINANZA - ECONOMETRICS FOR FINANCE
Attività Formativa Integrata	-
Partizione Studenti	-
Periodo Didattico	S2 - Secondo Semestre
Sede	
Anno Corso	1
Settore	SECS-P/05 – ECONOMETRIA
Tipo attività Formativa	B – Caratterizzante
Ambito	50493 – Economico
CFU	10.0
Ore Attività Frontali	90.0
AF_ID	28736

Tipo Testo	Codice Tipo Testo	Num. Max. Caratteri	Ob bl.	Testo in Italiano	Testo in Inglese
Obiettivi Formativi Del	OBIETT_FORM	3800	Sì	Conoscenza dei principali metodi di analisi dei fenomeni economici,	Main methods of analysis of economic phenomena, analysis and

Corso / Course Formative Objectives				analisi e previsione delle serie storiche economiche e finanziarie. Utilizzo di software statistico-econometrici.	forecasting of economic and financial time series. Using statistical and econometric software.
Prerequisiti / Prerequisites	PREREQ	3800	Sì	Algebra lineare. Statistica ed econometria base.	Linear Algebra. Basic statistics and econometrics.
Contenuti Del Corso / Course Contents	CONTENUTI	3800	Sì	Modello di regressione lineare per dati cross-section. Stimatori IV. Modelli per dati panel. Modelli per variabili risposta binarie. Modelli per serie storiche. Processi stocastici lineari. Stazionarietà. Modelli ARMA. Misura ed analisi della volatilità. Modelli ARCH e GARCH.	Linear regression model for cross-sectional data. IV estimators. Models for panel data. Models for binary response variables. Time series models. Linear stochastic processes. Stationarity. ARMA models. Measurement and analysis of the volatility. ARCH and GARCH models.
Programma Esteso E Materiale Didattico Di Riferimento: Settimana 1 / Extended Program And Reference Reading Material: Week 1	PROGR_EST_1	3800	Sì	Introduzione. Modello lineare per dati cross-section.	Introduction. Linear model for cross-sectional data.
Programma Esteso E	PROGR_EST_2	3800	Sì	Modello lineare per dati cross-	Linear model for cross-sectional

Materiale Didattico Di Riferimento: Settimana 2 / Extended Program And Reference Reading Material: Week 2				section: stima e inferenza.	data: estimation and inference.
Programma Esteso E Materiale Didattico Di Riferimento: Settimana 3 / Extended Program And Reference Reading Material: Week 3	PROGR_EST_3	3800	Sì	Modello lineare per dati cross-section: heteroskedasticity.	Linear model for cross-sectional data: heteroskedasticity.
Programma Esteso E Materiale Didattico Di Riferimento: Settimana 4 / Extended	PROGR_EST_4	3800	Sì	Modello lineare per dati cross-section: stimatori IV.	Linear model for cross-sectional data: IV estimators.

Program And Reference Reading Material: Week 4					
Programma Esteso E Materiale Didattico Di Riferimento: Settimana 5 / Extended Program And Reference Reading Material: Week 5	PROGR_EST_5	3800	Sì	Modelli per dati panel.	Models for panel data.
Programma Esteso E Materiale Didattico Di Riferimento: Settimana 6 / Extended Program And Reference Reading Material: Week 6	PROGR_EST_6	3800	Sì	Modelli per variabili risposta binarie.	Models for binary response variables.

Programma Esteso E Materiale Didattico Di Riferimento: Settimana 7 / Extended Program And Reference Reading Material: Week 7	PROGR_EST_7	3800	No	Processi stocastici lineari e stazionarietà	Linear and stationary stochastic processes
Programma Esteso E Materiale Didattico Di Riferimento: Settimana 8 / Extended Program And Reference Reading Material: Week 8	PROGR_EST_8	3800	No	Modelli ARMA, identificazione, stima, interpretazione e previsione	ARMA models, identification, estimation, interpretation and prediction
Programma Esteso E Materiale Didattico Di Riferimento:	PROGR_EST_9	3800	No	Modelli ARMA, identificazione, stima, interpretazione e previsione	ARMA models, identification, estimation, interpretation and prediction

Settimana 9 / Extended Program And Reference Reading Material: Week 9					
Programma Esteso E Materiale Didattico Di Riferimento: Settimana 10 / Extended Program And Reference Reading Material: Week 10	PROGR_EST_1 0	3800	No	Misura ed analisi della volatilità	Measurement and analysis of the volatility
Programma Esteso E Materiale Didattico Di Riferimento: Settimana 11 / Extended Program And Reference Reading	PROGR_EST_1 1	3800	No	Modelli ARCH e GARCH, identificazione, stima, interpretazione e previsione	ARCH and GARCH models, identification, estimation, interpretation and prediction

Material: Week 11					
Programma Esteso E Materiale Didattico Di Riferimento: Settimana 12 / Extended Program And Reference Reading Material: Week 12	PROGR_EST_1 2	3800	No	Modelli ARCH e GARCH, identificazione, stima, interpretazione e previsione. Modelli a volatilità stocastica.	ARCH and GARCH models, identification, estimation, interpretation and prediction. Stochastic volatility models.
Testi Di Riferimento / Reference Books	TESTI_RIF	3800	Sì	Marno Verbeek, A Guide to Modern Econometrics, Wiley, 2012, 4th Edition. R.S. Tsay. Analysis of Financial Time Series, Wiley, 2010. 3rd Edition. Durante le lezioni possono essere indicate ulteriori letture per alcuni argomenti.	Marno Verbeek, A Guide to Modern Econometrics, Wiley, 2012, 4th Edition. R.S. Tsay. Analysis of Financial Time Series, Wiley, 2010. 3rd Edition. Further readings may be assigned during the classes.
Metodologie Didattiche / Teaching Method	METODI_DID	3800	Sì	Didattica frontale, esercitazioni e applicazioni pratiche con l'utilizzo di software statistico-econometrici.	Lectures, practical applications and demonstration of the use of statistical and econometric software.
Modalita' Di Verifica	MOD_VER_AP PR	3800	Sì	Home assignment (30% del voto finale). Esame scritto (70% del voto	Home assignment (30% of final grade). Written exam (70% of final

Dell'apprendimento / Assessment Method				finale).	grade).
Criteria Per L'assegnazione Dell'elaborato Finale / Criteria for assigning the Master thesis	CRIT_ASS_ELA	3800	Si	Interesse per la materia. Colloquio individuale.	Interest in the subject. Individual interview.