

Insegnamento	SSD	Obiettivi formativi
5901 000 000 13178 - 0 - ECONOMETRIA DEI MERCATI FINANZIARI	SECS-P/05	Al termine del corso lo studente possiede gli strumenti di base per l'analisi quantitativa dei mercati finanziari. In particolare, lo studente è in grado di: - specificare, stimare e interpretare modelli econometrici che spieghino l'evoluzione di prezzi, quantità e volatilità delle attività scambiate sui mercati finanziari - effettuare analisi empiriche tramite software econometrici.
5901 000 000 B5519 - 0 - ANALISI DELLE SERIE STORICHE PER LA FINANZA E LE ASSICURAZIONI	SECS-S/01	Il corso introduce gli elementi fondamentali dell'analisi delle serie storiche e la teoria della previsione. La prima parte del corso fornisce allo studente le basi teoriche dell'analisi moderna delle serie temporali e della previsione. Questo include le analisi esplorative, la stima della tendenza e il problema della non stazionarietà, l'analisi del ciclo e della stagionalità. La classe dei processi lineari ARMA è adottata come paradigma teorico per la modellazione e la previsione. La seconda parte del corso è dedicata all'analisi di serie temporali provenienti dall'ambito finanziario e assicurativo usando librerie software specializzate. Questo permette allo studente di adattare modelli per serie temporali ed effettuare previsioni basate su solide fondamenta matematiche. Verranno discusse anche alcune estensioni alla modellistica non lineare, come, ad esempio, i modelli per la varianza condizionata e i modelli a soglia. Questo preparerà lo studente per corsi più avanzati, diretti ad ambiti specifici, quali, la valutazione del rischio, l'analisi di rendimenti finanziari, tassi di interesse, tassi di cambio e la dinamica delle commodity.