



<i>Insegnamento</i>	STATISTICA PER LA FINANZA
<i>Settore Scientifico disciplinare</i>	SECS-S/03
<i>Corso e Classe di studio</i>	ECONOMIA MANAGERIALE – LM-77
<i>Docente</i>	CLAUDIO CONVERSANO
<i>Anno di corso nel quale viene impartito l'insegnamento</i>	2°
<i>Semestre</i>	1°
<i>Crediti assegnati</i>	6
<i>Prerequisiti</i>	Conoscenze di base di statistica descrittiva (indici di posizione, indici di variabilità, indici di forma, correlazione) degli elementi di calcolo delle probabilità, delle principali variabili casuali discrete e continue (v.c. binomiale, v.c. normale, v.c. t di Student, v.c. Chi quadro, v.c. F di Snedecor Fisher) dei metodi di stima (stima per intervalli e verifica delle ipotesi).
<i>Obiettivi formativi dell'insegnamento</i>	Finalità del corso è' fornire agli studenti gli elementi di base dei metodi di analisi dei dati finanziari, attraverso lezioni teoriche ed esercitazioni pratiche tenute in aula informatica. Vengono presentati ed approfonditi diversi casi studio che prevedono l'analisi di dati reali.
<i>Contenuti dell'insegnamento</i>	Argomenti trattati: <ol style="list-style-type: none">1. Caratteristiche degli strumenti finanziari (Azioni, Obbligazioni, Valute, Prodotti derivati)2. Richiami di inferenza statistica (Variabili casuali univariate e multivariate)3. Analisi tecnica (Analisi grafica ed analisi per indicatori)4. Il modello di regressione lineare semplice e multipla5. Il modello di regressione logistica6. Analisi dei prezzi (Exponential smoothing, Processi random walk, Forme di efficienza dei mercati finanziari)7. Analisi dei rendimenti (Analisi della distribuzione empirica, Stima non parametrica, Struttura temporale dei rendimenti, Modelli AR(I)MA, Test di Radice Unitaria, Previsione nei modelli AR(I)MA)8. Analisi della volatilità (Misure di volatilità, Modelli ARCH, Modelli GARCH, Modelli con effetti asimmetrici, Previsione nei modelli (G)ARCH
<i>Metodo d'insegnamento</i>	- lezioni frontali in aula - approfondimento di alcuni argomenti in programma attraverso lezioni in aula informatica consistenti nell'utilizzo di software statistico
<i>Verifiche dell'apprendimento / procedure di valutazione</i>	L'esame consiste in un colloquio orale sugli argomenti trattati durante il corso. Agli studenti, organizzati per gruppi, sarà inoltre richiesto di preparare una relazione scritta concernente l'analisi statistica di dati finanziari reali da effettuarsi usando il software statistico R. Il contenuto della relazione è oggetto di discussione e valutazione in sede di esame.
<i>Lecture consigliate</i>	Gallo G., Pacini M. Metodi quantitativi per i mercati finanziari, Carocci, 2002. Pastorello S., Rischio e rendimento, Il Mulino, 2001.
