

CORSO DI LAUREA MAGISTRALE IN ECONOMIA AZIENDALE E MANAGEMENT

Metodi Quantitativi per l'Economia e la Finanza a.a. 2019-2020, II Anno, II Semestre, 9 Cfu

Rania Francesco

Informazioni Corso	Corso: Metodi Quantitativi per l'Economia e alla Finanza Modulo: intero Cfu: 9 Anno: 2 di Cdl Magistrale in Economia Aziendale e Management Semestre: II Anno accademico: 2019-2020
Informazioni Docente	Docente: Prof. Francesco Rania Indirizzo mail: raniaf@unicz.it Telefono: 0961-3694987 Orari di ricevimento: Durante il periodo delle lezioni prima e dopo le stesse e con cadenza mensile prima dell'appello d'esame.
Descrizione del Corso	Lo scopo del corso è quello di fornire strumenti matematici e modelli probabilistici per indagare fenomeni di Economia e Finanza.
Obiettivi del Corso e Risultati di Apprendimento attesi	Lo studente dovrà: <i>a)</i> applicare semplici modelli econometrici alla Finanza; <i>b)</i> possedere gli elementi matematici di base per la comprensione di modelli relativi al funzionamento dei mercati ed alla valutazione degli strumenti finanziari.
Programma (contenuti, modalità di svolgimento). Eventuale distinzione programma frequentanti – non frequentanti	<u>Elementi di Statistica</u> : Organizzazione e rappresentazione di dati; Indicatori sintetici di posizione centrale, di variabilità, di asimmetria e di forma; Relazioni Statistiche; Variabili casuali; Stima, Verifica di ipotesi. <u>Analisi bivariata</u> : tabulazione incrociata di variabili categoriali, verifica della dipendenza; regressione semplice di una variabile cardinale, assunzioni, metodo OLS, verifica e stima del regressore, verifica del modello. <u>Analisi multivariata</u> : regressione multipla di una variabile, metodo OLS, verifiche e stime dei regressori, verifiche del modello; regressione logistica di una variabile categoriale, Odds ratio; regressione con effetti temporali; le assunzioni e gli errori standard della regressione con effetti fissi <u>Processi stocastici</u> : processi di Gauss, Markov e Wiener. <u>Analisi dei dati finanziari</u> : Prezzi, rendimenti, quote; Modello di Markowitz; Frontiera efficiente; Avversione al rischio; Modello a indice singolo; Selezione del portafoglio ottimo in un contesto downside risk. <u>Il metodo event study</u> : La procedura; Analisi statistica; Analisi con più titoli; Applicazione della metodologia event study a un caso aziendale. <u>Il modello di Black e Litterman</u> : L'approccio di equilibrio, view dell'investitore e livello di confidenza, L'approccio bayesiano al modello, Il modello di Black e Littermann. <u>Elementi di Finanza sociale</u>

	<u>Gestione integrata del rischio:</u> Il rischio di mercato, Il value at risk, Metodi per il calcolo del Var, Il rischio di credito, Il metodo di CreditMetrics, I derivati creditizi, Il rischio operativo, Copertura del rischio operativo, Metodo di base, Metodo standardizzato, Metodi avanzati.																			
Stima dell’Impegno Orario richiesto per lo Studio individuale	150 ore (con una media di 4 ore al giorno).																			
Metodi di Insegnamento utilizzati	Lezione frontale, problem-solving, esercitazioni in aula.																			
Risorse per l’Apprendimento (libri di testo consigliati, eventuali ulteriori letture consigliate per approfondimento, altro materiale didattico)	<u>Libri di testo</u> <ul style="list-style-type: none"> • James H. Stock, Mark W. Watson, Introduzione all'econometria, redatto da F. Peracchi, Pearson Addison Wesley (edizione del 2009 o successiva). • Marco Micocci, Giovanni Battista Masala, Manuale di Matematica Finanziaria Metodi e strumenti quantitativi per il risk management, Carocci editore 2012. <u>Ulteriori letture consigliate per approfondimento</u> <ul style="list-style-type: none"> • Hansjoerg Albrecher, Andreas Binder, Volkmar Lautscham, Philipp Mayer, Introduction to Quantitative Methods for Financial Markets, Birkauer Basel Springer 2013. • Gujarati: Basic Econometrics, Fourth Edition McGraw-Hill 2004 																			
Attività di Supporto	Eventuali seminari sulle tematiche più attuali.																			
Modalità di Frequenza	Le modalità sono indicate dall’art.8 del Regolamento didattico del CdL.																			
Modalità di Accertamento	<p>Il Corso prevede prove di valutazione intermedia, con valore esonerativo per i soli frequentanti. L’esame di profitto finale sarà svolto in forma scritta e orale.</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>Votazione</th> <th>Conoscenza e comprensione dell’argomento</th> <th>Capacità di analisi e di sintesi</th> <th>Utilizzo di referenze</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>Non idoneo</td> <td>Importanti carenze. Significative inaccurately</td> <td>Irrilevanti. Frequenti generalizzazioni. Incapacità di sintesi</td> <td>Completamente inappropriato</td> </tr> <tr> <td>18-20</td> <td>A livello soglia. Imperfezioni evidenti</td> <td>Capacità appena sufficienti</td> <td>Appena appropriato</td> </tr> <tr> <td>21-23</td> <td>Conoscenza routinaria</td> <td>E’ in grado di effettuare analisi e sintesi corrette. Argomenta in</td> <td>Utilizza le referenze standard</td> </tr> </tbody> </table>				Votazione	Conoscenza e comprensione dell’argomento	Capacità di analisi e di sintesi	Utilizzo di referenze	Non idoneo	Importanti carenze. Significative inaccurately	Irrilevanti. Frequenti generalizzazioni. Incapacità di sintesi	Completamente inappropriato	18-20	A livello soglia. Imperfezioni evidenti	Capacità appena sufficienti	Appena appropriato	21-23	Conoscenza routinaria	E’ in grado di effettuare analisi e sintesi corrette. Argomenta in	Utilizza le referenze standard
Votazione	Conoscenza e comprensione dell’argomento	Capacità di analisi e di sintesi	Utilizzo di referenze																	
Non idoneo	Importanti carenze. Significative inaccurately	Irrilevanti. Frequenti generalizzazioni. Incapacità di sintesi	Completamente inappropriato																	
18-20	A livello soglia. Imperfezioni evidenti	Capacità appena sufficienti	Appena appropriato																	
21-23	Conoscenza routinaria	E’ in grado di effettuare analisi e sintesi corrette. Argomenta in	Utilizza le referenze standard																	

				modo logico e coerente	
		24-26	Conoscenza buona	Ha capacità di analisi e di sintesi buone. Gli argomenti sono espressi coerentemente	Utilizza le referenze standard
		27-29	Conoscenza più che buona	Ha notevoli capacità di analisi e di sintesi	Ha approfondito gli argomenti
		30-30L	Conoscenza ottima	Ha ottime capacità di analisi e di sintesi	Importanti approfondimenti