

Codice	27003129
Denominazione Attività Formativa	STATISTICA PER I MERCATI FINANZIARI
Codice Settore	SECS-S/01
Ambito	Statistico
Tipo Insegnamento	OB - Caratterizzante
CFU	10
Anno Corso	I
Periodo Didattico	3°-4° (23/02/2015 – 30/05/2015)
DOCENTE	PERRI Pier Francesco
Codice Ruolo / Matricola	PA / 010755
Tipo Attività	LEZ
Ore	60
Tirocinio	NO
Lingua di insegnamento	Italiano
Contenuti	Il corso si pone l'obiettivo di descrivere le metodologie statistiche finalizzate all'analisi dei rendimenti finanziari quali grandezze fondamentali per la valutazione del rischio di mercato. La parte teorica, volta alla disamina critica dei cosiddetti "fatti stilizzati" dei dati finanziari verrà integrata e supportata con l'analisi empirica di serie finanziarie reali con l'ausilio di Excel e di R
Testi di riferimento	J. Franken, W. Hardle, C.M. Hafner (2008). Statistics of Financial Markets. Springer G. M. Gallo, B. Pacini (2002) Metodi quantitativi per i mercati finanziari. Carocci, Roma. D. Ruppert (2004) Statistics and Finance. An Introduction. Springer
Obiettivi formativi	Alla fine del corso, lo studente dovrà aver acquisito i principali strumenti statistici utilizzati nell'analisi empirica dei dati finanziari ed essere in grado di condurre analisi in maniera critica utilizzando opportuni pacchetti statistici.
Prerequisiti	Nozioni di Statistica, Statistica e Calcolo delle Probabilità, Inferenza Statistica, Laboratorio Statistico 1 e 2, Serie Storiche
Metodi didattici	Lezioni in aula integrate da attività in laboratorio
Altre informazioni	Pagina Docente: http://www.unical.it/portale/strutture/dipartimenti_240/disesf/servizi/perri/
Modalità di verifica dell'apprendimento	Prova orale e discussione di un elaborato
Programma esteso	Analisi descrittiva ed inferenziale dei rendimenti finanziari. Definizione di rendimento finanziario. Centralità, variabilità e forma dei rendimenti finanziari. La funzione di autocorrelazione tra diverse forme di rendimenti. Accertamento dell'autocorrelazione: metodi grafici e test. L'analisi empirica dei rendimenti e i fatti stilizzati. Test di normalità. La distribuzione statistica dei rendimenti. Modelli statistici per la distribuzione dei rendimenti. Modelli ad eteroschedasticità condizionata. La volatilità: definizione e caratteristiche. La struttura di un modello. Modelli GARCH e loro applicazione in finanza: ARCH(p), GARCH(p,q), I-GARCH, GARCH-M, E-GARCH, T-GARCH.



UNIVERSITÀ DELLA CALABRIA

DIPARTIMENTO DI
ECONOMIA, STATISTICA
E FINANZA

[0752] Corso di Laurea Magistrale in Statistica e Informatica per l'Azienda e la Finanza
– curriculum SFA (Statistica, Finanza ed Assicurazioni) -

SCHEDA INSEGNAMENTO a.a.2014-2015

	<p>Estensioni multivariate. L'analisi dei dati ad alta frequenza. I modelli di durata. Il modello autoregressive conditional duration (ACD). Caratteristiche e proprietà. Metodi di stima. Interpretazione dei parametri. Diagnostica dei modelli stimati.</p> <p>La teoria dei valori estremi. Le statistiche d'ordine e la distribuzione del massimo. Le statistiche per valori estremi. La distribuzione dei valori estremi: la Gumbel, la Frechet e la Weibull). L'approccio POT e la distribuzione Pareto Generalizzata. La teoria dei valori estremi per le serie storiche finanziarie.</p>
--	--