

<b>STRUTTURA</b>	Scuola Politecnica – Dipartimento SEAS
<b>ANNO ACCADEMICO</b>	2014-2015
<b>CORSO DI LAUREA (o LAUREA MAGISTRALE)</b>	Scienze Economiche e Finanziarie (Economic and Financial Analysis)
<b>INSEGNAMENTO</b>	Econometrics
<b>TIPO DI ATTIVITÀ</b>	CARATTERIZZANTE
<b>AMBITO DISCIPLINARE</b>	Economico
<b>CODICE INSEGNAMENTO</b>	15518
<b>ARTICOLAZIONE IN MODULI</b>	NO
<b>NUMERO MODULI</b>	1
<b>SETTORI SCIENTIFICO DISCIPLINARI</b>	SECS P05
<b>DOCENTE RESPONSABILE (MODULO 1)</b>	Andrea Cipollini Professore Associato
<b>CFU</b>	6
<b>NUMERO DI ORE RISERVATE ALLO STUDIO PERSONALE</b>	114
<b>NUMERO DI ORE RISERVATE ALLE ATTIVITÀ DIDATTICHE ASSISTITE</b>	36
<b>PROPEDEUTICITÀ</b>	Nessuna
<b>ANNO DI CORSO</b>	2
<b>SEDE DI SVOLGIMENTO DELLE LEZIONI</b>	Consultare il sito <a href="http://politecnica.unipa.it">politecnica.unipa.it</a>
<b>ORGANIZZAZIONE DELLA DIDATTICA</b>	Lezioni frontali, Esercitazioni in aula,
<b>MODALITÀ DI FREQUENZA</b>	Facoltativa, Obbligatoria
<b>METODI DI VALUTAZIONE</b>	Prova Scritta
<b>TIPO DI VALUTAZIONE</b>	Voto in trentesimi, Idoneità
<b>PERIODO DELLE LEZIONI</b>	Consultare il sito <a href="http://politecnica.unipa.it">politecnica.unipa.it</a>
<b>CALENDARIO DELLE ATTIVITÀ DIDATTICHE</b>	Consultare il sito <a href="http://politecnica.unipa.it">politecnica.unipa.it</a>
<b>ORARIO DI RICEVIMENTO DEGLI STUDENTI</b>	Lunedì' (14-16)

<p><b>RISULTATI DI APPRENDIMENTO ATTESI</b></p> <p><b>Conoscenza e capacità di comprensione</b> Acquisizione di metodi di previsione e di stima volti allo studio e alla misurazione dei fenomeni economici, allo scopo di dare contenuto empirico alle teorie economiche e finanziarie.</p> <p><b>Capacità di applicare conoscenza e comprensione</b> Capacità di fornire evidenza a supporto della validità delle teorie economiche, di avanzare previsioni sull'andamento futuro delle variabili economiche e finanziarie, al fine di utilizzare modelli per fini di politica economica e di decisioni in materia d' investimenti finanziario.</p> <p><b>Autonomia di giudizio</b> Capacità di interpretazione delle stime e previsioni ottenute nell' ambito di vari scenari, nonché' di valutazione della performance dei modelli usati allo scopo.</p> <p><b>Abilità comunicative</b> Capacità di esporre i risultati dell'analisi econometrica e di giustificarne, alla luce della teoria economica e statistica, la validità empirica.</p> <p><b>Capacità d'apprendimento</b> Capacità di comprensione di articoli scientifici che fanno uso di analisi empiriche di fenomeni economici e finanziari.</p>
---

**OBIETTIVI FORMATIVI DEL CORSO**

Obiettivo del corso è di illustrare l' uso dello stimatore di massima verosimiglianza per la stima di modelli lineari e non lineari, distinguendo tra modelli di regressioni uni-equazionali e multi-equazionali (dinamici). Il corso si propone di introdurre lo studente alla formulazione di previsioni fuori campione nell' ambito di scenari "medi" e particolarmente avversi. Applicazioni in laboratorio di EXCEL introducono lo studente all' uso degli strumenti di analisi usati a lezione per lo studio di decisioni in materia economica e finanziaria.

<b>ORE FRONTALI</b>	<b>LEZIONI FRONTALI</b>
2	Dynamic Linear Regression Models and Forecasting Part 1 (in sample and out of sample forecasting using OLS)
2	Dynamic Linear Regression Models and Forecasting Part 2 (indirect and direct method of forecasting using OLS; forecast evaluation)
2	Maximum Likelihood univariate analysis (linear regression model)
2	Maximum Likelihood univariate analysis (probit model; example of in sample and out-of-sample forecasting through probit; forecast evaluation)
4	Maximum Likelihood multivariate analysis (static equations)
2	Maximum Likelihood multivariate analysis (dynamic equations: reduced form VAR models)
6	Maximum Likelihood multivariate analysis (dynamic equations: structural form VAR models)
2	Forecasting under adverse scenarios: Introduction to Value at Risk
2	Example of Final Exam
	<b>ESERCITAZIONI</b>
2	Excel Applications Dynamic Models and Forecasting Part 1
2	Excel application to univariate Maximum Likelihood (linear regression model)
2	Excel application to univariate Maximum Likelihood (probit model)
2	Excel application to multivariate Maximum Likelihood (reduced form VAR)
4	Excel application to multivariate Maximum Likelihood (structural form VAR)
<b>TESTI CONSIGLIATI</b>	W.Greene: Econometric Analysis 5th edition, Prentice Hall.