

Nome docente	Caterina Marini
Corso di laurea	Scienze Statistiche
Anno accademico	2015 - 2016
Periodo di svolgimento	Primo Semestre
Crediti formativi universitari (CFU)	8
Settore scientifico disciplinare	SECS – S/03

Programma di Analisi delle Serie Storiche (A.A. 2015 - 2016)
(Prof. Caterina Marini)

Università degli Studi di Bari Aldo Moro

Corso di Laurea Triennale in Scienze Statistiche

Pre-requisiti: Conoscenza dei principali elementi di statistica inferenziale, statistica economica, economia e analisi matematica.

Obiettivi del Corso: *Obiettivo del corso è fornire allo studente gli elementi necessari per lo sviluppo dell'analisi stocastica delle serie storiche economiche e dei modelli econometrici connessi. All'interno del corso verranno illustrati sia dal punto di vista teorico, sia dal punto di vista pratico gli strumenti utili per l'analisi dei fenomeni economici attraverso campioni temporali.*

Programma

Parte I: Introduzione all'analisi delle serie storiche

Lo studio dei fenomeni che variano nel tempo.

Econometria e analisi delle serie storiche.

Processi stocastici, caratteristiche generali.

Processi stazionari, invertibili, ergodici.

Parte II: Modelli Econometrici di serie storiche

Modelli univariati e multivariati di serie storiche.

Esogeneità, causalità, identificazione nei modelli econometrici.

La stima e la verifica di ipotesi dei modelli lineari dei modelli univariati.

Analisi della specificazione nei modelli econometrici: scelta e validazione del modello.

Modelli ARCH e GARCH.

Modelli di serie storiche non stazionarie.

State Space Models: cenni.

Bibliografia:

- A. Gardini , G. Cavaliere , M. Costa , L. Fanelli , P. Paruolo - *Econometria. Volume I*, Franco Angeli Editore, Milano 2003.
- J.D. Hamilton - *Time Series Analysis*, Princeton University Press, Princeton, New Jersey 1994.
- *Dispense del docente.*

Modalità di accertamento conoscenze:

- Esoneri - No
- Prova Scritta - No
- Colloquio Orale - Si

Organizzazione della didattica:

- Cicli interni di lezione - No
- Corsi integrativi - No
- Esercitazioni - Si
- Seminari - No
- Attività di laboratorio - No
- Project work - No
- Visite di studio - No