

Nome docente	Nicolardi Vittorio
Corso di laurea	Corso di Laurea Magistrale in Statistica e metodi per l'economia e la finanza
Anno accademico	2015/16
Periodo di svolgimento	I semestre
Crediti formativi universitari (CFU)	8
Settore scientifico disciplinare	SECS-S/03

**Programma di Modelli previsivi (A.A. 2015-2016)
(Prof. Nicolardi Vittorio)**

Università degli Studi di Bari Aldo Moro
Corso di Laurea Magistrale in Statistica e metodi per l'economia e la finanza

Pre-requisiti:

Conoscenze di base di statistica multivariata, di econometria e di economia.

Obiettivi del corso:

Fornire allo studente gli elementi necessari per l'analisi temporale dei modelli interpretativi delle relazioni economiche e finanziarie tra le variabili che caratterizzano la struttura dei mercati, nonché dei modelli comportamentali delle unità economiche, sia a livello macroeconomico, sia a livello microeconomico, a fini previsivi.

Programma:

Metodi per l'analisi delle serie storiche:

- Teoria economica, dati statistici e modelli econometrici;
- L'informazione temporale;
- Stazionarietà; memoria ed ergodicità;
- Previsioni, innovazioni e proiezioni lineari;
- Operatore ritardo;
- Modelli univariati per dati stazionari: i processi ARMA;
- Metodi di stima e di controllo delle ipotesi;
- Modelli multivariati di serie storiche (cenni): i modelli VARMA multivariati.

L'analisi statistica delle relazioni economiche:

- Le relazioni deterministiche: causalità e interdipendenza;
- Completezza, identificazione e formulazione dei modelli;
- La stima dei parametri e la verifica delle ipotesi nei modelli uniequazionali;
- Le variabili dummy.

L'analisi della specificazione:

- Il confronto e la scelta tra modelli: modelli annidati e non annidati;
- Il confronto e la scelta tra modelli: metodi basati sulla bontà dell'adattamento e sull'encompassing.

La validazione dei modelli:

- Test di errata specificazione: esclusione di variabili rilevanti ed inclusione di variabili irrilevanti;
- Test di coerenza: autocorrelazione, omoschedasticità e normalità;
- Test di cambiamento strutturale;
- Test sulla forma strutturale.

Bibliografia:

- Gardini , G. Cavaliere , M. Costa , L. Fanelli , P. Paruolo - Econometria. Volume I, Franco Angeli Editore, Milano 2003.
- 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