

<b>Nome docente</b>	Nicolardi Vittorio
<b>Corso di laurea</b>	Corso di Laurea Magistrale in Statistica e metodi per l'economia e la finanza
<b>Anno accademico</b>	2017/18
<b>Periodo di svolgimento</b>	I semestre
<b>Crediti formativi universitari (CFU)</b>	8
<b>Settore scientifico disciplinare</b>	SECS-S/03

**Programma di Modelli previsivi (A.A. 2017-2018)  
(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:**

*Parte I: I modelli econometrici.*

- Teoria economica, dati statistici e modelli econometrici;
- L'informazione temporale;
- Operatore ritardo;
- Stazionarietà; memoria ed ergodicità;
- Previsioni, innovazioni e proiezioni lineari;
- I processi non stazionari per la media e per la varianza;

*Parte II: I modelli econometrici dinamici.*

- I modelli econometrici dinamici: concetti e definizioni;
- Esogeneità, causalità, identificazione e specificazione nei modelli econometrici;
- Analisi di specificazione e validazione dei modelli econometrici;
- Il modello dinamico di regressione multivariata.

*Parte III: Sistemi di equazioni simultanee.*

- I sistemi di equazioni simultanee. forma strutturale e forma ridotta;
- Il problema dell'identificazione nei sistemi di equazioni simultanee;
- Sistemi di equazioni simultanee: modelli VAR e VARMA;
- La stima dei sistemi di equazioni simultanee: forma ridotta e forma strutturale;
- Variabili strumentali;
- Metodi di stima a informazione limitata e completa;
- Test dei vincoli di sovraidentificazione,

**Bibliografia:**

- Gardini A., Cavaliere G., Costa M., Fanelli L., Paruolo P. - Econometria. Volume I, Franco Angeli Editore, Milano 2014 (Capp. 1 e 5).
- Gardini A., Cavaliere G., Costa M., Fanelli L., Paruolo P. - Econometria. Volume II, Franco Angeli Editore, Milano 2011 (Capp. 6 e 8 – escluso: VAR di cointegrazione in 8.3.1, par. 8.5).
- 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