

CORSO DI ANALISI DELLE SERIE STORICHE ECONOMICHE

(8 crediti)

A.A. 2013-2014

Corso di Studi Magistrale in Economia e Strategie per i Mercati Internazionali Docente Prof. Caterina Marini

Parte I: Introduzione all'analisi delle serie storiche

Lo studio dei fenomeni che variano nel tempo.

Econometria e analisi delle serie storiche.

Richiami di algebra delle matrici e statistica inferenziale.

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

Testi fondamentali:

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

Notizie su eventuali prove intermedie, prove esonerative ed esami finali e sulle loro modalità di svolgimento:

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

Forme di assistenza allo studio eventualmente previste:

- Corso presente nella zona in e-learning del Sito Web di Facoltà - No.
- Gli studenti potranno ottenere aiuto alla comprensione degli argomenti trattati durante il corso nei giorni di ricevimento.

Organizzazione della didattica, oltre alle lezioni frontali:

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