

# UNIVERSITÀ DEGLI STUDI DELL'AQUILA

## CORSI DI LAUREA DI ECONOMIA

### **Corso di ECONOMETRIA**

Anno Accademico 2013/2014 –Secondo Semestre  
(6 CFU – 40 ore – Laurea Magistrale LM-77)

**DOCENTE**  
Prof. TRIACCA Umberto

#### **OBIETTIVO**

Il corso mira a fornire agli studenti le nozioni di base e le tecniche econometriche in ambiente univariato. Gli studenti che abbiano superato l'esame saranno in grado di applicare le principali tecniche di analisi univariate e di fare previsioni utilizzando i modelli ARIMA.

#### **PROGRAMMA**

La nozione di processo stocastico. Stazionarietà ed ergodicità. Funzione di autocorrelazione, autocorrelazione parziale. I modelli MA, AR, ARMA ed ARIMA. Costruzione di un modello ARIMA (specificazione, stima e verifica). Utilizzo dei modelli ARIMA in previsione.

#### **TESTI**

1. Serie storiche economiche. T. Di Fonzo, F. Lisi, Carocci editore
2. Metodi quantitativi per i mercati finanziari G. Gallo B. Pacini, Carocci editore
3. Introduzione all'analisi delle serie storiche, D. Piccolo, Carocci editore

#### **METODO DI INSEGNAMENTO**

Lezioni frontali in aula ed esercitazioni pratiche basate sull'utilizzo del pacchetto econometrico open source GRET. L.

#### **ESAMI E CRITERI DI VALUTAZIONE**

L'esame consiste in:

1. Una prova scritta in cui si richiederà di risolvere esercizi di carattere teorico.
2. Una tesina da redigere a casa in cui si descrive la costruzione di un modello ARIMA per una data serie storica e si presentano le previsioni ottenute.

#### **RIFERIMENTI A PRECEDENTI ANNI ACCADEMICI**

Per queste informazioni inviare E-Mail al titolare del corso o chiedere in Segreteria Didattica.

#### **MATERIALE DIDATTICO ED ULTERIORI INFORMAZIONI**

Sul sito web dei corsi di Laurea di Economia viene reso disponibile eventuale materiale didattico e sono inoltre reperibili le informazioni relative a date, orari e aule delle lezioni, agli appelli d'esame, agli avvisi del docente e ai suoi dati personali compresi i recapiti telefonici e di posta elettronica.