

UNIVERSITÀ DEGLI STUDI DELL'AQUILA

CORSI DI LAUREA DI ECONOMIA

Corso di ECONOMETRIA

Anno Accademico 2014/2015 –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.