

Statistica per l'economia II modulo

Programma

1. Il modello di regressione lineare multiplo: struttura e inferenza statistica.
2. Processi stocastici e serie storiche economiche; Stazionarietà; Momenti di processi stazionari; Polinomi di ritardo.
3. Processi auto-regressivi a media mobile (ARMA); Condizioni di stazionarietà; Invertibilità e teorema di rappresentazione di Wold; Processi ARMA integrati (ARIMA).
4. Identificazione e stima dei modelli ARIMA; Principali test diagnostici; La previsione economica con i modelli ARIMA.
5. Trend deterministici e trend stocastici; definizione di processo $I(1)$; Test di radice unitaria.
6. Processi auto-regressivi vettoriali (VAR); identificazione e stima di modelli VAR; funzioni di risposta all'impulso; analisi di co-integrazione.

Testo di riferimento:

Lucidi disponibili nella pagina WEB del corso.

Riccardo Lucchetti (2011), Appunti di analisi delle serie storiche. Università di Ancona, Dipartimento di Economia. -

<http://www.econ.univpm.it/lucchetti/didattica/matvario/procstoc.pdf>

Software: GRET - http://gretl.sourceforge.net/gretl_italiano.html