

**Econometria**  
*Prof. Pierluigi Daddi*

**Argomenti:**

Aspetti base del modello di regressione, OLS, GLS;  
Analisi della stabilità;  
Convergenza stocastica e aspetti asintotici del modello di regressione stocastico;  
Teoria della regressione dinamica, DGP, processi VAR, causalità ed esogeneità;  
Alcune tipologie di modelli dinamici;  
Teoria della integrazione e cointegrazione;  
Test sulle radici unitarie e cointegrazione.

**Testo di riferimento:**

J. Davidson, *Econometric Theory*, Blackwell 2000.  
W. Enders, *Applied Economic Time Series*, Wiley & Sons, Inc., 1995.

**Prerequisiti (indicare possibilmente anche un testo di riferimento):**

Inferenza statistica , Modello lineare, Serie storiche economiche.

**Modalità didattica e di verifica:**

Discussione argomenti e predisposizione report

**N. ore di insegnamento/esercitazione:** 16 ore