

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