



# UNIVERSITÀ DI PISA

## TOPICS IN MACROECONOMETRICS

GIUSEPPE RAGUSA

|               |           |
|---------------|-----------|
| Academic year | 2020/21   |
| Course        | ECONOMICS |
| Code          | 610PP     |
| Credits       | 6         |

| Modules                        | Area      | Type    | Hours | Teacher(s)      |
|--------------------------------|-----------|---------|-------|-----------------|
| TOPICS IN<br>MACROECONOMETRICS | SECS-P/05 | LEZIONI | 42    | GIUSEPPE RAGUSA |

### Obiettivi di apprendimento

#### Conoscenze

Topics in Macroeconometrics si rivolge agli studenti che desiderano acquisire una conoscenza pratica dei metodi moderni utilizzati in macroeconomia e in finanza.

#### Modalità di verifica delle conoscenze

Per l'accertamento delle conoscenze saranno svolte delle prove in itinere.

#### Capacità

Gli studenti acquisiranno una conoscenza dell'econometria delle serie temporali che va dagli strumenti classici come i processi stazionari lineari (ARMA, VAR) alle tecniche che sono recentemente entrate nella cassetta degli attrezzi macroeconomista (econometria bayesiana, kalman filter, factor models)

#### Modalità di verifica delle capacità

Alcune lezioni saranno dedicate alle applicazioni empiriche per le quali sarà usato il software statistico Julia.

#### Modalità di verifica dei comportamenti

##### Frequenza

La frequenza alle lezioni è consigliata, così come una preparazione per una piena partecipazione alla lezione. Gli studenti che hanno problemi possono fare domande durante la lezione o durante l'orario di ricevimento.

##### Imbrogli o altre forme di disonestà

Non ci saranno tolleranze nei confronti di qualsiasi tipo di imbroglio. Gli studenti che saranno trovati a copiare non supereranno l'esame e il loro comportamento sarà riportato agli uffici competenti.

#### Prerequisiti (conoscenze iniziali)

Advanced Econometrics (246PP)

#### Bibliografia e materiale didattico

The main reference for this courses is:

- Brockwell, Peter J. and Richard A. Davis, Introduction to Time Series and Forecasting, Springer, 2002
- Enders, Walter. Applied econometric time series. John Wiley & Sons, 2008
- James D. Hamilton, Time Series Analysis, Princeton University Press, 2005

#### Modalità d'esame

La valutazione è basata interamente su homework assignments.

#### Pagina web del corso

<https://teams.microsoft.com/l/team/19%3a4dd78435d16646d9b6fe8d18c37e3dcb%40thread.tacv2/conversations?groupId=7af25703-eb1a-4d6f>



# UNIVERSITÀ DI PISA

[-9aee-341ae9e1121&tenantId=c7456b31-a220-47f5-be52-473828670aa1](#)

*Ultimo aggiornamento 18/02/2021 19:28*