



# UNIVERSITÀ DI PISA

---

## TOPICS IN MACROECONOMETRICS

**GIUSEPPE RAGUSA**

Anno accademico 2021/22  
CdS ECONOMICS  
Codice 610PP  
CFU 6

Moduli	Settore/i	Tipo	Ore	Docente/i
TOPICS IN 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.

Ultimo aggiornamento 17/02/2022 20:24