



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