

Corso di Analisi di scenario - anno accademico 2008/2009

Testi:

I. Cipolletta, *Congiuntura economica e previsione*, Il Mulino 1992. Capitoli I-VI.,

G. Marbach, C. Mazziotta, A. Rizzi, *Le previsioni : fondamenti logici e basi statistiche*, Milano: ETAS libri, 1991. Escluso capitolo 4

oppure *Dispensa a cura del docente* [Download](http://www.econ.uniurb.it/calagnini) (<http://www.econ.uniurb.it/calagnini>)

In alternativa ai materiali precedenti, l'esame può essere preparato anche su un testo in lingua inglese (disponibile in biblioteca):

Michael K. Evans, *Practical Business Forecasting*, Blackwell Publishing, 2003

Data lezione	Ora	Argomenti trattati	Riferimenti ai testi
9/2/09	9-11	Presentazione del corso; il metodo delle previsioni	Dispensa.
10/2/09	9-11	Introduzione al software GRETL; presentazione e prime elaborazioni del caso InnovaTex	Pagina web del corso
16/2/09	9-11	Introduzione al gioco di ruolo Multicountry. Le varie fasi della previsione.	Dispensa.
17/2/09	9-11	Metodi previsionali; tipi di previsioni.	Dispensa.
17/2/09	16-18	Multicountry; Elementi di macroeconomia	Dispensa.
19/2/09	16-18	Il modello di regressione (1); esempi con Gretl	Dispensa.
23/2/09	9-11	Prova di ipotesi	Dispensa.
24/2/09	9-11	Intervalli di confidenza	Dispensa.
2/3/09	9-11	Multicountry: la fissazione degli obiettivi. Il test F.	Dispensa.
3/3/09	9-11	Il test di Durbin-Watson e il problema della correlazione seriale degli errori. Il test h di Durbin.	Dispensa
3/3/09	16-18	Il problema delle variabili dummy. Esercitazioni con GRETL	Dispensa
9/3/09	9-11	Il trend e la stagionalità delle serie storiche. I test LM, Akaike, Scharwz. Esercitazioni con GRETL	Dispensa
10/3/09	9-11	Le indagini qualitative dell'ISAE e la loro capacità previsiva. Esercitazioni con GRETL	Dispensa
16/3/09	9-11	Il problema della simultaneità	Dispensa
17/3/09	9-11	Il metodo delle variabili strumentali (1); il test di Hausman	Dispensa
17/3/09	16-18	Il metodo delle variabili strumentali (2); esempi con Gretl	Dispensa
18/3/09	16-18	Il metodo delle variabili strumentali (3); esempi con Gretl; Simulazione gioco Multicountry.	Dispensa
23/3/09	9-11	Simulazione gioco Multicountry; La stazionarietà delle serie storiche.	Dispensa
24/3/09	9-11	Test di stazionarietà: Augmented Dickey-Fuller (ADF); Esempio indice MIBTEL (dati disponibili sulla pagina web); Simulazione gioco Multicountry.	Dispensa
30/3/09	9-11	Le previsioni mediante lo smoothing delle serie (1); Esercizi; Simulazione gioco Multicountry.	Appendice Dispensa + File Excel

31/3/09	9-11	Le previsioni mediante lo smoothing delle serie (2); Esercizi; Simulazione gioco Multicountry.	Appendice Dispensa + File Excel
31/3/09	16-18	Esercizi	Appendice Dispensa + File Excel
2/4/09	16-18	Le previsioni mediante lo smoothing delle serie (2); L'analisi delle serie storiche: la funzione di autocorrelazione e la funzione di autocorrelazione parziale; Simulazione gioco Multicountry.	Appendice Dispensa + Dispensa
21/4/09	9-11	Conclusione gioco Multicountry + seminario	
27/4/09	9-11	Stima dei modelli ARIMA (1)	Dispensa
28/4/09	9-11	Stima dei modelli ARIMA (2) + discussione argomenti tesina	Dispensa
28/4/09	16-18	Stima dei modelli ARIMA (3) + seminario	Dispensa
30/4/09	16-18	Discussione argomenti tesina	
3/5/09	9-11	Assistenza studenti	