

Il giro della statistica in 90'

Programma

MODELLI DI SCOMPOSIZIONE DI SERIE STORICHE

20.02.2013 11.00 – 12.30

- Analisi classica delle serie storiche con metodi globali e componenti deterministiche
- Generalizzazione dei modelli precedenti per considerare componenti stocastiche
- Confrontiamoci con la pratica: breve esercitazione
- Riepilogo e chiusura

Obiettivi formativi

Illustrare semplici metodi di scomposizione di una serie storica economica o sociale in componenti non osservabili quali stagionalità, trend, ciclo.

Prerequisiti

Conoscenza del modello di regressione lineare multipla

Metodi

Lezione teorica, esercitazione e dibattito

Lecture consigliate

T. Di Fonzo e F. Lisi, Serie storiche economiche, Carocci.

Docente

Giancarlo Bruno è ricercatore presso l'Istat ed esperto di analisi della congiuntura economica. Si interessa, in particolare, della destagionalizzazione di serie storiche economiche e di modelli di previsione a breve termine.

Parole chiave

Seriestoriche
trend
Componenti
stocastiche
stagionalità