**COSA HAI FATTO**

**PROBABILITà et INFERENZA (Ehrbar, Casella B., Spanos…Lubiani…Dwll’Aglio, Dispense Kella)**

**ESERCIZI….**

**FONDAMENTI DEL CALCOLO DI PROBABILITÀ**: insiemi, eventi, algebra, leggi De Morgan, prob condizionata, Bayes theorem

- concetto di varibile casuale: pdf,CDF, funzione quantile

-metodi di stima (ch 13 Spanos…principio dei momenti matching)

-

- teoremi limite del calcolo delle probabilità

**VARIABILI CASUALI SEMPLICI E MULTIVARIATE. PRINCIPALI DISTRIBUZIONI DELLE VARIABILI CASUALI DISCRETE E CONTINUE**

-Relazioni tra variabili aleatorie: dell’aglio III.3 (densità cogiunte, condizoonate indipemdemza…)

*HANS EBHAR*

**-***Ch 3* V.aleatorie: definizioni..costruzione…cdf…funzione quantile….misure di prob discrete e ass. continue..trasformazione diu una densità scalare….ex: variabile binomiale…statistica sufficiente

che manca? Pdf in modo più tradizionale..stat suff meglio, , Bayes theorem

*Ch 7:* limit theorems: disug di chebyshev; plim; LLN; CLT (cfr slides Rossi)

**ZWIRNER 3**

**-** Variabili aleatorie continue..definizione e condizioni perché esista una funzione di densità…di ripartzione, momenti, Valore atteso, variazna…moda, mediana…distribuzione uniforme.. etc…Normale..

**ZWIRNER 2**

-Analisi combinatoria (fogli accanto a combnatorics)

-intro prob…assiomatica…BAYES…

**GARETTO (STATISTICA)**

Definizione di prob matematica, frequenti sta (statistica)….PROBABILITà CONDIZIONATA…

che manca?

**SPANOS**

**-** Fondamenti del calcolo delle probabilità,

- Teoria della stima

-Stimatori

-CH 3: Concetto di variabile casuale; spazi finiti; variabile degenere…funzione indicatrice…

- ch 2 fino ad eventi indep…costruzione spazio di prob…bayes…etc

- CH 9 (Da completare) limit theorems (parte su slide ols asympt rossi)

- ch 12 Concetto e proprietà stimatore (accompagnato da slides 5 di Kella), Fischer info---Cramer Rao.--.

**LISEO (Azzalini, CASELLA B)**

- DISTRIBUZIONI discrete (beta binomiale)-

-MAX VEROSIMIGLIANZA (rICORDA: quando costruisci la funz di verosimi in alcuni casi devi mettere la funzioneindicatrice..es esponenziale

Variabili casuali discrete…principali distribuzioni

- ch 3 Modello prob e funzione di verosimiglianza (integri con Azzalini, Spanos, e casella)

**LUBIANI**

Convergenza in probabilità. ,convergenza quadratica, trasformazioni continue…consistenZA, disug,. Di chebyshev (ehrbahr), legge grandi numero (Kinchine, Chebyshev)

-proprietà asintotiche OLS (cfr slides Rossi)

**ECONOMETRIA (Hayashi, Amisano, Lucchetti)**

**ROSSI DISPENSE**

proprietà asintotiche OLS

**-**Modello di regressione lineare classico: ipotesi sul termine di errore, sui reg1ressori, stima dei parametri del modello…

**AMiSANO**

-intro…richiami di algebra matriciale

- Richiami Stat

- Minimi quadrati e assunzioni

**HAYASHI**

-OLS…assunzioni

**HANSEN**

**LUCCHETTI**

- ergodicità, staz, Wold, Ma, Lag, WN process.

**DISPENSE SEMBENELLI**

**ECONOMETRIA FOR DUMMIES**

**PROIETTI**

- ch 2 serie storiche, ACF parziale, staz, Wold, Ma, Lag, Wnoise

**GREEEN (MAgazzini)**

- Modelli per dati dicotomici (logit probit)…LPM, Variabile latente…

**RISCHIO**

**CALCOL O STOCASTICO PER LA FINANZA (PASCUCCI)**

che manca?

**ALEXANDER VOL**

**ECONOMIA DELLA BANCA E GESTIONE DEL RISCHIO (Dispense)**

che manca?

**HULL (credit risk) D&D (…)**

Frontiera portafogli

che manca?

**HULL (OPTION FUTURES ETC..)**