**.**

**+**

**ZWIRNER 3…**

punti di accumulazione

Es chap 1 pag 508—

G, N…roba con un numero negativo e suo esponente (n)…es 11 .

-es dato a Simone Giumarra...derivata secondA

**ZWIRNER 1…**

**-**CAP X1…passaggio di base dei log…in particolare dimostrazione delle proprietà che ne conseguono (pag 341 et seg---) OK!!!

- es capX1 pag 672 no 37

**ZWIRNER 2 …**

**-**CAP I…pag 11 esempio 4…

**-PROG EXCEL**

Comando Home/fill (cfr stat analysis excel 2009 2nd ed)

**BANCA D’ITALIA**

**ECONOMETRIA**

- random utility models (CFR GREENE Più MAGAZZINI slides)

-modelli probit si assume spesso che la distribuzione degli errori sia non solo normale, ma

abbia anche varianza unitaria. Cosa succede se si rimuove tale ipotesi?

- Si illustri per quali motivi i parametri crei modelli logit e pro bit sono generalmente stimati con

il metodo della massima verosimiglianza anziché come stimatori OLS

-tobit

Conteggio (es prova c on Alleva)

Omitted variable variazmza (cfr amisano pag 1321)…inconsistenza

Convoluzione…qualcosa su Bayes

Regressione partizionata

Legge della varianza totale e dell’aspettativa iterata secondo Peracchi (cfr sue dispense pag 10-12 )

-calcolo momenti normale multivariata…in generale le prime 15 pagine di Peracchi…gelo…

-durbin Watson

Problema su multicoll verbbek ch 2 par multicoll…

Storia dell’intercetta sull R^2

Linearità stimatore BLUE

**SERIE STORICHE**

- analisi spettrale acf

-Filtraggio H\_P

- periodogramma

- sarima

- common roots (8.2 Verbeck)

- Log

-livellamento exp

- cosa accade al processo se i parametri si avvivicnano alla zona di non stazionarietà…?

Arch in mean integrated arch

TS DS ADF

Ultimo PARTE GARCH

**INFERENZA**

Indipendenza ed incorrelazione differenza

**-**QUASI ML

-Statistiche sufficienti, d’ordine…sufficienza stimatore cfr pag 536 Piccolo

- esempo stimatore senza senso poisso…Epifani pag 8 teoria stima

-disugaglia cramer Rao

Teorema Rao Blackwell

**PROBABILITA’**

**-**Funzione quantile (rif pag 73 ebhar) OK!!\_

- convoluzione

Funzione caratteristica

**Hans Ehrbar**

Dimostrazione problema 51 pag 77…perché una pdf ha (può avere) solamente un numero contabil di salti??

-PAG 79-80 IMPARA BENE COME RIPORTARE alla nuova variabile quella vecchia e ottenerne la funzione di densità…

- PAG 17 DIMOSTRAZIONE legggi de Morgan con diagrami Eulero

**Esercizi prob e stat (18-12-14) in cartela** non capisco la varianza e lanon distorsione di quello stimatore dei momenti (es 1)