

Metodi Quantitativi Profilo Economico (seconda parte)

Modelli Dinamici

6 VARIABILI ENDOGENE RITARDATE

6.1 Esempi economici

- 6.1.1 La formazione di abitudini: effetti immediati ed effetti di lungo periodo
- 6.1.2 Il modello d'aggiustamento parziale
- 6.1.3 Il modello ad aspettative adattive

6.2. La stima dei modelli a variabili endogene ritardate

- 6.2.1 Errori indipendenti
- 6.2.2 Quando gli errori sono autocorrelati
- 6.2.3 Il test di autocorrelazione
- 6.2.4 Stima convergente ed asintoticamente efficiente

7 MODELLI CON RITARDI DISTRIBUITI

7.1 Specificazione e proprietà. Moltiplicatori d'impatto, moltiplicatori dinamici, ritardo medio

7.1.1 Specificazione

7.2 Distribuzione dei ritardi finita

- 7.2.1 Il caso generale
- 7.2.2 Distribuzione di Almon

7.3 Distribuzione dei ritardi infinita

- 7.3.1 Il modello
- 7.3.2 Distribuzione razionale dei ritardi: idea introduttiva
- 7.3.3 L'operatore di ritardo
- 7.3.4 Il modello dinamico di Jorgenson

8 SERIE MACROECONOMICHE NON STAZIONARIE

8.1 Stazionarietà e non stazionarietà

8.1.1 Stazionarietà

8.1.2 Non stazionarietà

8.1.3 Una riparametrizzazione del modello dinamico classico (Jorgenson)

8.1.4 Introduzione alla cointegrazione

Testi di riferimento

- BALTAGI, Badi H., *Econometrics*, Springer, 1998
- GREENE, W.H., *Econometric Analysis*, 3.rd Ed., Prentice Hall, 1997
- HAYASHI, F., *Econometrics*, Princeton University Press, 2000
- MADDALA, G.S., *Introduction to Econometrics*, 2.nd Ed., Prentice Hall, 1992