

Econometria Delle Serie Storiche

In a financial revolution, new determinants of performance arise and interest in the way performance is measured and communicated to stakeholders grows. This book presents a wide and accurate analysis of the impact that regulation, structural changes and new financial products have on the performance of markets and intermediaries.

Il testo tratta l'analisi delle serie storiche univariate, con particolare attenzione agli aspetti di modellistica, previsione e scomposizione. La parte sulla scomposizione e sulla destagionalizzazione costituisce una novità rispetto ai manuali tradizionali sull'analisi delle serie storiche. Infatti, pur essendo cruciale per l'identificazione del trend-ciclo e dei punti di svolta, la scomposizione non viene solitamente affrontata in modo approfondito. Un altro importante contributo è costituito da due casi di studio con delle serie storiche reali dove il lettore può seguire tutte le fasi sia della costruzione di un modello SARIMA mediante il software SPSS sia della scomposizione di una serie storica mediante il software X11ARIMA/2000. Il materiale presentato può trovare larga applicazione anche in discipline quali l'ingegneria, la medicina e, in generale, in tutti i settori in cui sia rilevante lo studio di osservazioni effettuate nel corso del tempo .

Annuario della Università Cattolica del Sacro Cuore ... e dello Istituto Superiore di Magistero "Maria Immacolata

L'economia italiana: metodi di analisi , misurazione e nodi strutturali. Studi per Guido M. Rey

Enciclopedia filosofica

L'industria, rivista di economia e politica industriale

Annali di statistica

È vero che sono i più capaci ad avere successo nella vita? --- Questo libro parla della fortuna. O meglio, del ruolo che gioca il caso nella nostra vita in generale, nei nostri affari in particolare. Ma parla anche di quella fortuna che, non essendo percepita come tale, viene scambiata per abilità: una confusione presente in molteplici campi, dalla scienza alla politica, dall'arte alla finanza. Quante volte abbiamo visto un idiota baciato dalla fortuna trovarsi nel posto giusto al momento giusto, dimostrazione vivente della «sopravvivenza del meno adatto»? Individui del genere attraggono seguaci devoti che credono ciecamente in quello che loro spacciano per metodo. «Giocati dal caso» affronta in modo affascinante e divertito alcune conseguenze che possono derivare da questo equivoco, mentre fa cadere come birilli i nostri pregiudizi sull'idea di successo e di sconfitta.

Includes Atti della Giunta centrale di statistica, 1872-1880; Atti del Consiglio superiore di statistica, 1882-1939 and Atti della Commissione per la statistica giudiziaria e notarile, 1882/83-1908.

Mercato, occupazione e salari

Gazzetta ufficiale della Repubblica italiana. Parte prima, serie generale

Scomposizione ed identificazione delle serie storiche nel campo delle frequenze

Analisi statistica delle serie storiche economiche

363.85

Econometria delle serie storicheEconometriaFrancoAngeliDynamic Model AnalysisAdvanced Matrix Methods and Unit-Root Econometrics Representation TheoremsSpringer Science & Business Media

Strategie e tecniche non convenzionali su Azioni, Opzioni, Future, Forex

Annuario per l'anno accademico

E-Government ICT Professionalism and Competences Service Science

Statistica

IFIP 20th World Computer Congress, Industry Oriented Conferences, September 7-10, 2008, Milano, Italy

This book constitutes the refereed proceedings of Industry Oriented Conferences held at IFIP 20th World Computer Congress in September 2008. The IFIP series publishes state-of-the-art results in the sciences and technologies of information and communication. The scope of the series includes: foundations of computer science; software theory and practice; education; computer applications in technology; communication systems; systems modeling and optimization; information systems; computers and society; computer systems technology; security and protection in information processing systems; artificial intelligence; and human-computer interaction. Proceedings and post-proceedings of refereed international conferences in computer science and interdisciplinary fields are featured. These results often precede journal publication and represent the most current research. The principal aim of the IFIP series is to encourage education and the dissemination and exchange of information about all aspects of computing.

This second edition sees the light three years after the first one: too short a time to feel seriously concerned to redesign the entire book, but sufficient to be challenged by the prospect of sharpening our investigation on the working of econometric dynamic models and to be inclined to change the title of the new edition by dropping the "Topics in" of the former edition. After considerable soul searching we agreed to include several results related to topics already covered, as well as additional sections devoted to new and sophisticated techniques, which hinge mostly on the latest research work on linear matrix polynomials by the second author. This explains the growth of chapter one and the deeper insight into representation theorems in the last chapter of the book. The rôle of the second chapter is that of providing a bridge between the mathematical techniques in the backstage and the econometric profiles in the forefront of dynamic modelling. For this purpose, we decided to add a new section where the reader can find the stochastic rationale of vector autoregressive specifications in econometrics. The third (and last) chapter improves on that of the first edition by re- ing the fruits of the thorough analytic equipment previously drawn up.

Giocati dal caso

Analisi delle serie storiche: modellistica, previsione e scomposizione

New Drivers of Performance in a Changing World

Enciclopedia italiana di scienze, lettere ed arti: Quinta appendice 1979-1992 (5 v.) [6] Appendice 2000. pt. 1. A-LA. pt. 2. LE-Z. pt. 3. Indici 1929-2000 A- K. pt. 4. L-Z. pt. 5. Eredità del Novecento

Inflation, Growth and Monetary Control

Il volume raccoglie i contenuti delle lezioni di un corso di specializzazione per gli studenti della Facoltà di Economia sul tema della metodologia della ricerca scientifica in economia. L'interesse suscitato presso gli studenti, i colleghi e i ricercatori ha indotto a prevederne la pubblicazione. I saggi affrontano alcune tematiche di fondamentale importanza nella scienza economica come il ruolo delle aspettative e dell'incertezza, le ipotesi della modellistica degli strumenti finanziari, il fallimento globale alla base della crisi finanziaria iniziata nel 2007 e non ancora conclusa. Il corso è stato svolto da Luca Barone, Rainer Masera, Chiara Oldani, Salvatore Rossi e Paolo Savona. I contributi di questo volume mostrano la pericolosità degli errori compiuti da taluni economisti e policy maker sulla base di un'acritica applicazione dei paradigmi di mercati efficienti, razionali, autocorrettivi. Il volume è a cura di Rainer Masera.

Il libro si rivolge al trader e all'investitore che vuole approcciare i mercati finanziari con regole meccaniche. In particolare sono descritte e spiegate, in modo preciso e rigoroso, alcune strategie operative su Azioni, Opzioni, Forex e Future. L'opera approfondisce diversi temi fondamentali come l'analisi della robustezza di una strategia di trading, la gestione del rischio e il money management. Descrive inoltre due strategie decisamente interessanti, solitamente utilizzate da Hedge Fund, come gli Short Strangle con Difesa Meccanica sul Future e lo Spread Trading Meccanico sulle Commodities basato sulle stagionalità. Il lettore è pertanto guidato, passo dopo passo, alla scoperta di differenti metodologie di trading che sono state codificate dall'autore e che, nel corso degli anni, si sono dimostrate efficaci. Ogni capitolo riporta infine diversi esempi reali e alcuni codici in formato Easy Language che possono essere immediatamente utilizzati dal lettore.

Advanced Matrix Methods and Unit-Root Econometrics Representation Theorems

Convegno Banca d'Italia - CIDE, Perugia, 6-8 novembre 1997

Trasformazioni economiche e competitività locale

Modelli ed applicazioni nell'analisi della domanda

L'apparato analitico dell'econometria delle serie storiche ed i teoremi di rappresentazione

Classical econometrics - which plunges its roots in economic theory with simultaneous equations models (SEM) as offshoots - and time series econometrics - which stems from economic data with vector autoregr- sive (VAR) models as offsprings - scour, like the Janus's facing heads, the flowing of economic variables so as to bring to the fore their autonomous and non-autonomous dynamics. It is up to the so-called final form of a dynamic SEM, on the one hand, and to the so-called representation theorems of (unit-root) VAR models, on the other, to provide informative closed form expressions for the trajectories, or time paths, of the economic vari ables of interest. Should we look at the issues just put forward from a mathematical standpoint, the emblematic models of both classical and time series econometrics would turn out to be difference equation systems with ad hoc characteristics, whose solutions are attained via a final form or a represen tation theorem approach. The final form solution - algebraic technicalities apart - arises in the wake of classical difference equation theory, display ing besides a transitory autonomous component, an exogenous one along with a stochastic nuisance term. This follows from a properly defined ma trix function inversion admitting a Taylor expansion in the lag operator be cause of the assumptions regarding the roots of a determinant equation pe culiar to SEM specifications.

Econometria

Dynamic Model Analysis

Enciclopedia italiana di scienze, lettere ed arti

Topics in Dynamic Model Analysis

Modelli e strumenti per l'analisi economica a breve termine