Libro de il Mulino (Bologna) “Econometria” vol. 1, Paruolo, Costa, etc. il capitolo sui processi stocastici e i modelli ARMA.

Cap. 8 del **Verbeek** esclusa la parte su test di radice unitaria.

**Stock e Watson, quarta edizione**:

-oltre a quanto già detto/visto a lezione ai fini dell’esame è richiesto studiare il **capitolo 14** sui modelli AR e ADL per uso previsionale, esclusa la parte sui test di radice unitaria.

-**capitolo 15** sulla stima degli effetti causali dinamici con serie temporali: solo i modelli DL (fino a p. 458, sez. 15.5 esclusa) e l’applicazione sulla relazione tra prezzi del succo d’arancia e le gelate in Florida (da pag. 464).

-**cap. 16** su modelli VAR, solo pag. 481-486 (escl. Previsioni multiperiodali dirette).