

Appunti del corso di Modelli Stocastici

Vincenzo Manzoni

Aprile 2006

Argomenti trattati

Introduzione ai modelli stocastici in questa prima parte, si fa un ripasso del teorema del limite centrale e del modello di regressione lineare, analizzando il ruolo delle ipotesi IID (*indipendenza e uguale distribuzione*). Il materiale su cui studiare sono le slide di Fassò.

Stima dei parametri in questa parte, si parla dei diversi modi per stimare i parametri di un modello. Propedeutico per lo studio è la conoscenza del concetto di *normalità asintotica* dello stimatore. I principali metodi visti sono:

- il *metodo dei momenti* (solo un accenno);
- la *stima di massima verosimiglianza* (in modo approfondito).

Il materiale sono le slide di Fassò e una dispensa scritta da lui per il corso dell'anno scorso. La potete trovare su ILIAS3 sotto la voce "Materiale 2006"

Normale multivariata e analisi di normalità

Simulazione stocastica metodi Montecarlo per la simulazione stocastica. Montecarlo, Ipercubi latini e Bootstrap.