



EUTERPE

| | | | |
|---------------------------------|--|----------------|------------|
| Progetto | Estimation of the term premium in Euro Area government bonds | | |
| Acronimo | EUTERPE | | |
| Durata | 24 mesi | | |
| Avvio | 01/04/2018 | Termine | 01/05/2020 |
| Finanziamento | MSCA - Individual Fellowship | | |
| Responsabile scientifico | Andrea Berardi | | |
| Area scientifica | | | |
| Abstract | Lo scopo del progetto EUTERPE (EUropean TERm Premium Estimation) è quello di implementare un sistema innovativo che produca stime tempestive e affidabili del premio a termine e delle sue componenti per i titoli di Stato dell'Area Euro (EA). Il progetto mira a colmare un'importante lacuna nella letteratura esistente proponendo una procedura integrata che si basa su un nuovo modello di struttura a termine multinazionale con interrelazioni tra curve dei rendimenti, variabili macro, volatilità e fattori globali. EUTERPE intende dotare i responsabili politici europei di un nuovo strumento analitico per le loro decisioni di politica monetaria e ha potenzialmente diverse applicazioni nel settore finanziario, rappresentando così un modo per utilizzare efficacemente la conoscenza in Europa a fini commerciali e politici. | | |
| Budget Progetto | € 180.277,20 | | |
| Budget UNIVE | € 180.277,20 | | |