



**UNIVERSITÀ POLITECNICA DELLE MARCHE  
FACOLTÀ DI ECONOMIA “GIORGIO FUÀ”**

Corso di Laurea Magistrale in Scienze Economiche e Finanziarie

**USO DI VARIABILI MACROECONOMICHE  
NELLA PREVISIONE DELLA VOLATILITÀ:  
UN MODELLO GARCH-MIDAS**

**USING MACRO VARIABLES FOR VOLATILITY  
FORECASTS: A MIDAS-GARCH MODEL**

Relatore:

Prof. Riccardo Lucchetti

Correlatore:

Prof. Giulio Palomba

Tesi di Laurea di:

Orest Prifti

Anno accademico 2019 - 2020