

MANAGEMENT DIGITALE (LB46)

(Lecce - Università degli Studi)

Insegnamento PRINCIPI DI ECONOMETRIA

GenCod A005228

Docente titolare Pierluigi TOMA

Docenti responsabili dell'erogazione
CAMILLA MASTROMARCO (in
copresenza), Pierluigi TOMA

Insegnamento PRINCIPI DI
ECONOMETRIA

Insegnamento in inglese PRINCIPLES
OF ECONOMETRY

Settore disciplinare SECS-P/05

Corso di studi di riferimento
MANAGEMENT DIGITALE

Tipo corso di studi Laurea

Crediti 8.0

Ripartizione oraria Ore Attività frontale: 48.0

Per immatricolati nel 2019/2020

Erogato nel 2020/2021

Anno di corso 2

Lingua ITALIANO

Percorso GENERALE

Sede Lecce

Periodo Secondo Semestre

Tipo esame Orale

Valutazione Voto Finale

Orario dell'insegnamento

<https://easyroom.unisalento.it/Orario>

BREVE DESCRIZIONE DEL CORSO

L'econometria è lo studio delle applicazioni dei metodi statistici all'analisi di modelli economici, aziendali, finanziari e sociali. La natura dei fenomeni oggetto d'analisi rende improbabile che le assunzioni sottostanti ai metodi statistici vengano rispettate, e pertanto si ricorre ad approcci econometrici. Il corso tratta le principali tecniche di analisi econometrica utilizzate nelle applicazioni economiche, aziendali e finanziarie e le ricadute operative dei contenuti metodologici del corso saranno illustrate mediante applicazioni, col ricorso a software econometrici.

PREREQUISITI

Non sono previste propedeuticità ma, seppur trattasi di un corso introduttivo all'analisi econometrica, sono richieste conoscenze di base in matematica e statistica.

OBIETTIVI FORMATIVI

Il corso intende fornire allo studente un'introduzione ai metodi econometrici per assisterlo nell'attività di verifica empirica di tematiche economiche, finanziarie e aziendali e nella trattazione di dati quantitativi con l'utilizzo di tecniche computazionali. Alla fine del corso ci si attende che lo studente sia in grado di:

- valutare criticamente le applicazioni in letteratura basate su questi modelli;
- applicare i metodi illustrati per condurre le proprie analisi con software econometrici;
- essere in grado di utilizzare efficientemente software specializzati per l'analisi quantitativa dei fenomeni economici e finanziari;
- presentare e interpretare i risultati delle ricerche empiriche in maniera rigorosa.

Per questo motivo, il corso ha un contenuto fortemente applicato e prevede un'attività parallela di esercitazione al computer con l'utilizzo di alcuni programmi applicativi di analisi econometrica open-source.

METODI DIDATTICI

Il corso alterna, durante ogni lezione, aspetti teorici e applicati (presentazione di situazioni emblematiche ed esempi pratici tratti dalla realtà economica, con l'ausilio di PC e proiettore). La modalità di erogazione della didattica potrà variare a seguito delle misure di distanziamento sociale legate all'emergenza Covid-19.

MODALITA' D'ESAME

Frequentanti: prova scritta e consegna di un lavoro empirico originale (tesina), da discutere durante la prova orale. Non frequentanti: prova orale.

La modalità d'esame potrà variare a seguito delle misure di distanziamento sociale legate all'emergenza Covid-19.

Lo studente, disabile e/o con DSA, che intende usufruire di un intervento individualizzato per lo svolgimento della prova d'esame deve contattare l'ufficio Integrazione Disabili dell'Università del Salento all'indirizzo paola.martino@unisalento.it

PROGRAMMA ESTESO

1. Introduzione di alcuni concetti di probabilità e inferenza statistica.
 2. Il Modello Lineare di Regressione Semplice.
 3. Il Modello Lineare Classico di Regressione Multipla.
 4. Funzioni di regressione non lineari.
 5. Valutazione degli studi di regressione.
-

TESTI DI RIFERIMENTO

Testi base:

- **Testo di riferimento principale**(a cui si riferiscono i capitoli sopra citati):

- J. H. Stock e M. W. Watson, a cura di F. Peracchi, (2005), *Introduzione all'Econometria*, Milano, Pearson. (Testo molto semplice e discorsivo da affiancare alle dispense del docente);
- Dispense del docente su tutti gli argomenti trattati saranno disponibili nel sito web.

Altri testi consigliati:

- M. Verbeek, (2006), *Econometria*, Zanichelli. (Testo molto completo con un livello medio di difficoltà e approfondimento);
- G. Koop, (2008), *Introduction to Econometrics*, John Wiley & Sons. (Testo semplice e completo, in inglese);
- G. G. Judge, R. C. Hill, W. E. Griffiths, H. Lütkepohl, Tsoung-Chao Lee, (1988), *Introduction to the Theory and Practice of Econometrics*, Wiley. (Testo semplice e completo, in inglese);
- G. S. Maddala, (2001) *Introduction to Econometrics*, 3rd Edition, Wiley. (Testo semplice e completo, in inglese);
- D. N. Gujarati, (1995), *Basic Econometrics* McGraw Hill. (Testo di complessità media, completo nella trattazione degli argomenti, in inglese);

Testi avanzati:

- G. Amisano, (2004), *Elementi di Econometria. Un'introduzione ai concetti e alle tecniche di base*, Mondadori Università.
- W. H. Greene, (2003), *Econometric Analysis*, Macmillan, New York, 5th edition. (cap. 1, 2, 3, 4, 6, 7, 11, 12, 13, 16, 18. Un elenco dettagliato dei paragrafi rilevanti sarà fornito durante il corso).
- N. Cappuccio, R. Orsi, *Econometria* (nuova edizione), Il Mulino.
- J. M. Wooldridge, *Introductory Econometrics: A Modern Approach*, Second Edition (2002), South-Western College Publishing.
- J. Johnston, (1994), *Econometrica*, Franco Angeli.
- H. Lütkepohl e M. Krätzig, (2006), *Applied Time Series Econometrics*, Cambridge University Press.