ECONOMIA E FINANZA (LB06)

(Lecce - Università degli Studi)

Insegnamento ECONOMETRIA

GenCod 00324

Docente titolare CAMILLA MASTROMARCO

Insegnamento ECONOMETRIA

Anno di corso 3

Insegnamento in inglese ECONOMETRICS

Lingua ITALIANO

Settore disciplinare SECS-P/05

Percorso PERCORSO COMUNE

Corso di studi di riferimento ECONOMIA E FINANZA

Tipo corso di studi Laurea

Sede Lecce

Crediti 6.0

Periodo Secondo Semestre

Ripartizione oraria Ore Attività frontale: 48.0

Tipo esame Scritto

Per immatricolati nel 2015/2016

Valutazione Voto Finale

Erogato nel 2017/2018

Orario dell'insegnamento https://easyroom.unisalento.it/Orario

BREVE DESCRIZIONE DEL CORSO	L'econometria è lo studio delle applicazioni dei metodi statistici all'analisi dei fenomeni economici. La natura dei fenomeni economici rende improbabile che le assunzioni sottostanti ai metodi statistici vengano rispettate. Cosa distingue l'econometria dalla statistica è lo studio dei problemi che derivano dalla violazione delle assunzioni statistiche. Il corso tratta le principali tecniche di analisi econometrica utilizzate nelle applicazioni economiche e finanziarie.
PREREQUISITI	Sebbene si tratti di un corso introduttivo all'analisi econometrica, sono richieste conoscenze di base in matematica e statistica inferenziale.
OBIETTIVI FORMATIVI	Il corso intende fornire allo studente una gamma articolata di metodi econometrici per assisterlo nell'attività di verifica empirica di tematiche economiche e finanziarie e nella trattazione di dati quantitativi con l'utilizzo di tecniche di elaborazione elettronica. Per questo motivo, il corso ha un contenuto fortemente applicato, con richiami alla teoria economica, finanziaria e alle sue applicazioni, e prevede un'attività parallela di esercitazione su computer, fondata sull'utilizzo del laboratorio informatico della Facoltà e di alcuni programmi applicativi disponibili in tale sede. Tutti gli argomenti affrontati saranno oggetto di esercitazione al computer.
METODI DIDATTICI	Lezioni frontali e al computer con l'utilizzo di software econometrici.
MODALITA' D'ESAME	Frequentanti: prova intermedia scritta e consegna di tesina. Non frequentanti: prova scritta.
ALTRE INFORMAZIONI UTILI	Tutto il materiale didattico, completo di lezioni, esercitazioni e prove di esame, è disponibile nel sito personale www.camillamastromarco.it

PROGRAMMA ESTESO

1. Introduzione: il significato dei modelli economici ed econometrici. Il ruolo dell'econometria nell'ambito delle scienze economiche.
2. Richiami di alcuni concetti di inferenza statistica.
3. Il modello lineare classico: ipotesi, il metodo di stima dei minimi quadrati ordinari, proprietà statistiche degli stimatori dei minimi quadrati ordinari, il metodo della massima verosimiglianza.
4. Inferenza nel modello lineare classico: verifica d'ipotesi lineari, test t e F, i minimi quadrati vincolati.
5. Cenni di teoria delle distribuzioni limite.
6. Proprietà in grandi campioni dello stimatore dei minimi quadrati ordinari, dello stimatore di massima verosimiglianza e dei test statistici connessi.
7. Il modello lineare dinamico.
8. La diagnostica nel modello lineare: test di stabilità strutturale, test di corretta specificazione della media, test d'autocorrelazione, test d'eteroschedasticità.
9. Il metodo di stima delle variabili strumentali: motivazione, proprietà degli stimatori, test di Sargan e test di Hausman.
10. Il modello lineare generalizzato: lo stimatore dei minimi quadrati generalizzati e sue proprietà.
11. I modelli panel ad effetti fissi e causali (cenni).
12. Serie Temporali. Processi stocastici: definizione e proprietà. Stazionarietà. I processi autoregressivi (AR) e a media mobile (MA).

TESTI DI RIFERIMENTO

Testi base:

- 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);
- 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.

- **Note:** Dispense del docente su tutti gli argomenti trattati saranno disponibili nel sito web.