ECONOMIA E FINANZA (LB06)

(Lecce - Università degli Studi)

Insegnamento ECONOMETRIA

GenCod A004700

Docente titolare Andrea UGOLINI

Insegnamento ECONOMETRIA

Anno di corso 3

Insegnamento in inglese Econometrics

Lingua ITALIANO

Settore disciplinare SECS-P/05

Percorso ECONOMIA DELL'INNOVAZIONE

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 Orale

Per immatricolati nel 2018/2019

Valutazione Voto Finale

Erogato nel 2020/2021

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

BREVE DESCRIZIONE DEL CORSO

L'econometria è una branca dell'economia che integra: teoria economica, statistica e matematica, che consente di convalidare empiricamente teorie economiche, confrontare empiricamente diverse teorie sullo stesso fenomeno e prevedere i valori di determinate variabili economiche oltre la dimensione temporale del campione. In questa misura l'econometria diventa uno strumento fondamentale per il futuro professionista. In questo corso vengono trattare le principali tecniche di analisi econometrica utilizzate nelle applicazioni economiche e finanziarie.

PREREQUISITI

Seppure sia un corso introduttivo all'analisi econometrica, sono richieste conoscenza di base in statistica con elementi di statistica inferenziale e nozioni di base di analisi matematica e calcolo matriciale.

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 ed esercitazioni in aula, possibilmente utilizzando un software econometrico. Dovuto alla attuale situazione. La metodologia didattica potrà variare a seguito delle misure di distanziamento sociale legate all'emergenza epidemiologica da Covid-19.

MODALITA' D'ESAME

Una prova scritta con risoluzione di problemi teorici e pratici simili a quelli indicati alla fine dei capitoli del libro. Inoltre, sarà richiesta la consegna di una tesina alla fine del corso, la quale sarà discussa alla prova orale.

PROGRAMMA ESTESO

1. Richiami di alcuni concetti di probabilità e inferenza statistica.
2. Il Modello Lineare Classico di Regressione.
3. Regressione Multipla.
4. Funzioni di regressione non lineari.
5. Valutazione degli studi di regressione.
6. Regressione con dati panel.
7. Regressione con variabile dipendente binaria.
8. Il metodo di stima delle variabili strumentali: motivazione, proprietà degli stimatori, test di Sargan e test di Hausman.
9. Serie Storiche. Processi stocastici: definizione e proprietà. Stazionarietà. I processi autoregressivi (AR) e a media mobile (MA).

TESTI DI RIFERIMENTO

▪ **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..
▪ 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.