

# ECONOMIA E FINANZA (LB06)

(Lecce - Università degli Studi)

## Insegnamento ECONOMETRIA

GenCod A004700

**Docente titolare** Pierluigi TOMA

**Insegnamento** ECONOMETRIA

**Anno di corso** 3

**Insegnamento in inglese** Econometrics **Lingua** ITALIANO

**Settore disciplinare** SECS-P/05

**Percorso** FINANZIARIO

**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** 2020/2021

**Valutazione** Voto Finale

**Erogato nel** 2022/2023

**Orario dell'insegnamento**

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

### BREVE DESCRIZIONE DEL CORSO

L'econometria è una scienza che coniuga teoria economica e tecniche statistiche al fine di analizzare dati del mondo reale. Essa risponde all'esigenza di trovare una risposta quantitativa ad una varietà di domande economiche come la determinazione della relazione esistente tra diverse variabili o la possibilità di prevedere il loro andamento temporale. Durante il corso verranno approfondite le principali tecniche econometriche utilizzate nelle applicazioni economiche e finanziarie, affiancando alla teoria l'analisi empirica dei dati

### PREREQUISITI

Pur trattandosi di un corso introduttivo all'Econometria, sono richieste delle conoscenze di base in statistica inferenziale e matematica.

### OBIETTIVI FORMATIVI

Acquisire le conoscenze di base relative all'approccio econometrico e ai fondamenti metodologici della disciplina al fine di comprendere e analizzare i principali modelli econometrici. Acquisire la conoscenza delle tecniche quantitative di base al fine di comprendere le modalità con le quali realizzare e interpretare modelli econometrici. Attraverso le nozioni acquisite lo studente sarà pertanto in grado di analizzare e interpretare specifici fenomeni micro e macro economici con applicazioni quantitative. In particolare lo studente sarà in grado di elaborare un report che, partendo da assunzioni relative alla teoria economica, dimostri o confuti le assunzioni attraverso strumenti quantitativi. Altresì lo studente acquisirà la capacità di utilizzare un software econometrico per analisi quantitative. Al termine del percorso di studio lo studente avrà acquisito la capacità di effettuare una autonoma ricerca di dati economici e sociali ed una analisi ed interpretazione critica degli stessi. Inoltre, sarà in grado di elaborare autonomamente giudizi sul valore di strumenti quantitativi ed econometrici anche complessi. Lo studente sarà infine in grado di illustrare le conoscenze acquisite con linguaggio tecnico e adeguato alle diverse tipologie di destinatari (esperti del settore o meno), realizzando altresì efficaci presentazioni (anche mediante collaborazione di gruppo) e sostenendo contraddittori sugli argomenti inerenti il corso.

---

## METODI DIDATTICI

L'insegnamento prevede lezioni frontali in aula su tutti gli argomenti contenuti nel programma. Prevede altresì esercitazioni, integrate con le lezioni, che si svolgono in aula sulla progettazione e realizzazione di un lavoro empirico.

Circa metà delle ore di didattica erogate saranno incentrate sull'econometria computazionale e quindi su lezioni laboratoriali, con l'ausilio di software econometrici open source come GRetl e R.

---

## MODALITA' D'ESAME

Le modalità d'esame sono differenti a seconda che gli studenti siano dichiarino frequentanti (partecipazione ad almeno il 70% delle lezioni) o non frequentanti.

Gli studenti non frequentanti sosterranno alternativamente:

una prova scritta sugli argomenti del programma, con una parte teorica (n. 2 domande) e una parte applicata (n. 2 esercizi);

una prova orale, della durata indicativa di 20 minuti articolata in n.2 domande pratiche e n. 2 domande teoriche.

Gli studenti frequentanti avranno l'opportunità di sostenere, alternativamente:

una prova intermedia scritta sui contenuti affrontati nella prima parte del corso (lezioni da 1 a 6 come precedentemente elencate), con una durata indicativamente di 1 ora ed articolata in n. domande 4 di cui n 2 esercizi e n. 2 domande teoriche ed un lavoro di gruppo (composto da max 3 persone) che ha ad oggetto le fattispecie trattate nelle lezioni da 1 a 10 e che verrà presentato pubblicamente alla fine del corso. La discussione del lavoro di gruppo coinvolgerà il singolo studente personalmente.

un esame generale in forma orale o scritta, ciascuna delle quali articolata come illustrato per gli studenti frequentanti.

L'obiettivo della prova d'esame (in tutte le modalità sopra illustrate) consiste nel verificare il livello di raggiungimento degli obiettivi di apprendimento precedentemente indicati.

In particolare, gli esercizi sono finalizzati a verificare che gli studenti sappiano effettuare analisi quantitative, operando le scelte corrette in relazione alla complessità ed alla peculiarità del caso oggetto del singolo esercizio, e dimostrando quindi discernimento ed autonomia di giudizio.

Le domande teoriche afferiscono alla conoscenza e alla abilità comunicativa relative all'approccio econometrico e ai fondamenti metodologici della disciplina.

Il lavoro di gruppo (studenti frequentanti) afferisce sia alla conoscenza della materia, sia all'abilità di sviluppare e analizzare un caso concreto interpretando specifici fenomeni micro e macro economici e dimostrando o confutando le assunzioni attraverso strumenti quantitativi. Altresì lo studente deve dimostrare di saper presentare in modo chiaro, articolato e con linguaggio tecnico il lavoro

---

## ALTRE INFORMAZIONI UTILI

In qualunque momento, può essere richiesto il ricevimento su appuntamento, scrivendo all'indirizzo [pierluigi.toma@unisalento.it](mailto:pierluigi.toma@unisalento.it)

---

## 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

Dispense, slides e materiale fornito dal docente.

Testo di consultazione:

J. H. Stock e M. W. Watson, a cura di F. Peracchi, (ultima edizione disponibile), Introduzione all'Econometria, Milano, Pearson