ECONOMIA E FINANZA (LB06)

(Lecce - Università degli Studi)

Insegnamento ECONOMETRIA

GenCod A004700

Docente titolare Andrea UGOLINI

Docente responsabile dell'erogazione GIADA ANDREA PRETE

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 2019/2020

Valutazione Voto Finale

Erogato nel 2021/2022

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

Obiettivo principale del corso è quello di fornire allo studente gli strumenti necessari a comprendere ed utilizzare le principali tecniche econometriche in ambito economico, finanziario e aziendale.
Nello specifico, alla fine del corso, lo studente sarà in grado di:
- specificare modelli idonei a condurre le proprie analisi empiriche, applicando le tecniche apprese durante le lezioni;
- utilizzare efficientemente software di analisi econometrica, grazie alle attività di esercitazione con programmi applicativi open-source;
- interpretare e commentare in maniera rigorosa i risultati ottenuti nelle analisi condotte;
- sviluppare una capacità di lettura critica di articoli scientifici che presentano studi empirici.

METODI DIDATTICI

Lezioni ed esercitazioni con l'utilizzo di software econometrici (modalità a distanza).

MODALITA' D'ESAME

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