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 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 2016/2017

Valutazione Voto Finale

Erogato nel 2018/2019

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.
"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"

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. 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

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.

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