

STRUTTURA	Scuola Politecnica
ANNO ACCADEMICO	2012-2013
CORSO DI LAUREA	Economia e Finanza (L33)
INSEGNAMENTO	Econometria
TIPO DI ATTIVITÀ	Caratterizzante
AMBITO DISCIPLINARE	Economico
CODICE INSEGNAMENTO	2081-02694
ARTICOLAZIONE IN MODULI	NO
NUMERO MODULI	
SETTORI SCIENTIFICO DISCIPLINARI	SECS-P/05
DOCENTE RESPONSABILE	Iolanda Lo Cascio Ricercatore Università di Palermo
CFU	8
NUMERO DI ORE RISERVATE ALLO STUDIO PERSONALE	128
NUMERO DI ORE RISERVATE ALLE ATTIVITÀ DIDATTICHE ASSISTITE	72
PROPEDEUTICITÀ	Economia Politica II, Statistica II.
ANNO DI CORSO	Terzo
SEDE DI SVOLGIMENTO DELLE LEZIONI	Consultare il sito www.politecnica.unipa.it
ORGANIZZAZIONE DELLA DIDATTICA	Lezioni frontali, Esercitazioni in aula, Esercitazioni in laboratorio.
MODALITÀ DI FREQUENZA	Facoltativa
METODI DI VALUTAZIONE	Prova Orale
TIPO DI VALUTAZIONE	Voto in trentesimi
PERIODO DELLE LEZIONI	Consultare il sito www.politecnica.unipa.it
CALENDARIO DELLE ATTIVITÀ DIDATTICHE	Consultare il sito www.politecnica.unipa.it
ORARIO DI RICEVIMENTO DEGLI STUDENTI	Giovedì Ore 12-14

RISULTATI DI APPRENDIMENTO ATTESI

Conoscenza e capacità di comprensione

Acquisizione di metodi statistici e matematici volti allo studio e alla misurazione dei fenomeni economici, allo scopo di dare contenuto empirico alle teorie economiche.

Capacità di applicare conoscenza e comprensione

Capacità di fornire evidenza a supporto della validità delle teorie economiche, di avanzare previsioni sull'andamento futuro delle variabili economiche e di utilizzare modelli per fini di politica economica.

Autonomia di giudizio

Capacità di valutare le implicazioni di natura economica e finanziaria di risultati empirici ottenuti da applicazioni tratte dalla teoria.

Abilità comunicative

Capacità di esporre i risultati dell'analisi econometrica e di giustificarne, alla luce della teoria economica e statistica, la validità empirica.

Capacità d'apprendimento

Capacità di comprensione di articoli scientifici che fanno uso di analisi empiriche di fenomeni

economici.

OBIETTIVI FORMATIVI DEL CORSO
 Obiettivo del corso è quello di illustrare le principali metodologie di analisi econometrica (di tipo statico) ossia di quella disciplina che studia l'applicazione di metodi statistici e matematici allo studio e alla misurazione dei fenomeni economici, allo scopo di dare contenuto empirico alle teorie economiche, di fornire evidenza a supporto della validità delle stesse, di avanzare previsioni sull'andamento futuro delle variabili economiche e di utilizzare modelli per fini di politica economica. Il corso fornisce inoltre una buona padronanza delle principali metodologie di analisi econometrica di tipo dinamico. In aggiunta agli aspetti teorico-metodologici, il corso offre notevole spazio ad applicazioni tratte dalla teoria economica, tanto di tipo microeconomico che di tipo macroeconomico, ivi incluse le problematiche di natura finanziaria.

ORE FRONTALI	LEZIONI FRONTALI
2	Richiami di probabilità e statistica
6	Modello di regressione lineare; stimatori OLS dei parametri della funzione di regressione; stimatori di massima verosimiglianza.
4	Stime con vincoli sui parametri; errori di specificazione: inclusione di variabile irrilevante ed esclusione di variabili rilevanti; multicollinearità.
8	Modello di regressione lineare generalizzato; eteroschedasticità; autocorrelazione degli errori; stimatori dei minimi quadrati generalizzati.
4	Non linearità; ipotesi di normalità degli errori; uso delle variabili dummy.
1	Instabilità dei parametri del modello lineare; Break strutturali e test per la loro presenza
3	Modelli dinamici: specificazione, stima, inferenza e controllo diagnostico; Modelli con variabile dipendente ritardata; Modelli a ritardi distribuiti; Autocorrelazione e non corretta specificazione
2	Uso del trend nella regressione; Stime con variabili non stazionarie; Cointegrazione.
4	Specificazione dinamica di un modello uniequazionale; Modello a correzione dell'errore.
2	Modelli per la volatilità delle serie finanziarie: ARCH e GARCH
4	Cenni sui modelli multiequazionali: Problemi legati alla non stazionarietà
4	MODELLI PER DATI PANEL: Modelli SUR; modelli con effetti fissi; modelli con effetti stocastici
4	MODELLI PER DATI QUALITATIVI: modello lineare con variabile dipendente binaria; modelli LOGIT e PROBIT: specificazione, stima e interpretazione dei coefficienti stimati; valutazione della bontà esplicativa del modello.
ESERCITAZIONI	
12	Applicazioni economiche e finanziarie di modelli uniequazionali statici
12	Applicazioni economiche e finanziarie di modelli uniequazionali dinamici
TESTI CONSIGLIATI	Marcellino M. (2006), <i>Econometria applicata: un'introduzione</i> , Egea. Dispense del corso (esercitazioni e materiale didattico integrativo) Cappuccio N., Orsi R. (1991), <i>Econometria</i> , Bologna, Il Mulino, cap.V e cap VII (soltanto pp.445-468), tavv. 6 e 7 dell'Appendice statistica. Stock J.H, M.W. Watson (2005), <i>Introduzione all'Econometria</i> , Pearson, Prentice Hall.