



UNIVERSITÀ DEGLI STUDI DI PALERMO

DIPARTIMENTO	Scienze Economiche, Aziendali e Statistiche		
ANNO ACCADEMICO OFFERTA	2018/2019		
ANNO ACCADEMICO EROGAZIONE	2020/2021		
CORSO DILAUREA	ECONOMIA E FINANZA		
INSEGNAMENTO	ECONOMETRIA C.I.		
CODICE INSEGNAMENTO	18811		
MODULI	Si		
NUMERO DI MODULI	2		
SETTORI SCIENTIFICO-DISCIPLINARI	SECS-P/05		
DOCENTE RESPONSABILE	LO CASCIO IOLANDA	Professore Associato	Univ. di PALERMO
ALTRI DOCENTI	LO CASCIO IOLANDA	Professore Associato	Univ. di PALERMO
	DE LUCA GIUSEPPE	Professore Associato	Univ. di PALERMO
CFU	6		
PROPEDEUTICITA'	06649 - STATISTICA 2 02799 - ECONOMIA POLITICA 2		
MUTUAZIONI			
ANNO DI CORSO	3		
PERIODO DELLE LEZIONI	2° semestre		
MODALITA' DI FREQUENZA	Facoltativa		
TIPO DI VALUTAZIONE	Voto in trentesimi		
ORARIO DI RICEVIMENTO DEGLI STUDENTI	DE LUCA GIUSEPPE Lunedì 10:00 12:00 Martedì 12:00 14:00 Stanza 5.14 LO CASCIO IOLANDA Venerdì 10:00 12:00		

PREREQUISITI	Il corso richiede la conoscenza di statistica di base e inferenziale e di algebra matriciale
RISULTATI DI APPRENDIMENTO ATTESI	1) Conoscenza e capacita' di comprensione: il corso fornisce allo studente le conoscenze necessarie per comprendere gli strumenti dell'econometria e la loro applicabilita' alla soluzione di problemi economici e finanziari di interesse. Lo studente sara' capace di misurare le variabili economiche non-osservabili (ad esempio la propensione marginale al consumo), di verificare la validita' delle teorie economiche (ad esempio la teoria del reddito permanente), di prevedere l'andamento futuro delle variabili economiche reali e finanziarie (ad esempio i consumi, l'inflazione e la volatilita' dei titoli azionari) e di valutare gli effetti delle politiche macro e micro-economiche (ad esempio l'effetto di una riduzione delle imposte sul deficit pubblico). 2) Capacita' di applicare conoscenza e comprensione: tramite le esercitazioni in aula e i laboratori, lo studente sara' in grado di condurre analisi empiriche (previsioni e stime) per rispondere a domande economiche e finanziarie di interesse. 3) Autonomia di giudizio: lo studente sara' capace di valutare criticamente, tramite l'analisi dei modelli stimati, le implicazioni di natura economica e finanziaria dei risultati empirici ottenuti. 4) Abilita' comunicative: lo studente apprendera' come presentare ed interpretare i risultati dell'analisi econometrica e di giustificarne, alla luce della teoria statistica ed economica, la validita' empirica. 5) Capacita' di apprendimento: il corso consente allo studente di comprendere i concetti di base dell'econometria e fornisce gli strumenti per la realizzazione di ricerche elementari nel campo dell'econometria applicata.
VALUTAZIONE DELL'APPRENDIMENTO	La valutazione dell'apprendimento avviene attraverso un colloquio orale subordinato al superamento della prova scritta (in itinere). Il superamento di tale prova, sulla prima meta' del programma, consente allo studente di concentrarsi sulla seconda parte del programma per la prova orale. Nell'eventualita' di mancato superamento della prova in itinere, lo studente e' tenuto a sostenere l'esame orale su tutto il programma del corso. PROVA SCRITTA (IN ITINERE) La prova scritta (anche in itinere) mira a rilevare le conoscenze, le competenze, le abilita' possedute dallo studente e la sua capacita' critica nel riportarle in un elaborato scritto che tenga conto anche della proprieta' di linguaggio statistico/ economico posseduto. La prova, della durata di 2 ore, prevede un quesito, articolato in 4 sottopunti , di natura pratica e teorica a risposta chiusa. Lo studente avra' a disposizione dati economico/finanziari sulla base dei quali dovra' stimare relazioni economiche, testare appropriate ipotesi e, dopo verifica dell'appropriata specificazione, essere in grado di trarre considerazioni economiche . Il superamento della prova in itinere consentira' allo studente di essere valutato, all'orale, sulla restante parte del corso. In caso contrario, lo studente e' tenuto a rispondere, all'orale, a domande (pratiche e teoriche) su tutto il programma. PROVA ORALE La prova orale , su modelli dinamici con variabili stazionarie e non stazionarie,, mira ad approfondire la valutazione dell'apprendimento dello studente. nel caso di valutazione pienamente soddisfacente. METODO DI VALUTAZIONE FINALE DEL MODULO Il voto finale sara' pari alla media aritmetica delle votazioni conseguite nella prova in itinere e nella prova orale : La soglia di sufficienza (pari a un punteggio di 18 su una scala 18-30), necessaria al superamento della prova in itinere, e' raggiunta se lo studente mostra un utilizzo adeguato dei termini relativi ai soli concetti base e con l'individuazione della idonea metodologia statistica ed econometrica anche se viziato dal mero errore di calcolo (purche' coerente con la metodologia stessa); ii) nel caso di quesito teorico, nella coerenza della risposta, seppur non completamente esaustiva dell'argomento. La soglia della sufficienza della prova orale sara' raggiunta quando lo studente abbia mostrato conoscenza e comprensione degli argomenti almeno nelle linee generali (definizione dei concetti) e abbia competenze applicative minime, consistenti nella identificazione della adeguata metodologia econometrica per il problema economico oggetto di studio. Quanto piu', invece, l'esaminando abbia brillantemente superato la prova scritta e abbia dato evidenza, nella prova orale, delle sue capacita' argomentative ed espositive, tanto piu' la valutazione sara' positiva

ORGANIZZAZIONE DELLA DIDATTICA	Lezioni frontali, Esercitazioni in aula, Esercitazioni in laboratorio
---------------------------------------	---

MODULO MICROECONOMETRIA

Prof. GIUSEPPE DE LUCA

TESTI CONSIGLIATI

Il testo di riferimento è:

Stock J.H. e Watson M.W. (2012), Introduzione all'Econometria (terza edizione), Pearson Education Italia.

Altre dispense e articoli di letteratura verranno fornite durante il corso. Altri utili riferimenti bibliografici sono:

Peracchi F. (1995), Econometria, McGraw-Hill Italia.

Greene (2003), Econometric Analysis, Pearson Education.

Verbeek M. (2006), Econometria, Zanichelli.

Wooldridge J.M. (2009), Introductory Econometrics. A Modern Approach (4th Ed.), South-Western Cengage Learning.

TIPO DI ATTIVITA'	C
AMBITO	10705-Attività formative affini o integrative
NUMERO DI ORE RISERVATE ALLO STUDIO PERSONALE	49
NUMERO DI ORE RISERVATE ALLE ATTIVITA' DIDATTICHE ASSISTITE	26

OBIETTIVI FORMATIVI DEL MODULO

1. Possedere un glossario di base della terminologia econometrica e statistica.
2. Conoscere le principali metodologie utilizzate per l'analisi inferenziali di fenomeni socio-economici, le assunzioni sottostanti la specificazione, stima e validazione di un modello di regressione lineare e possibili generalizzazioni, le proprietà teoriche dei sottostanti stimatori.
3. Capacità di elaborare dati reali e svolgere autonomamente analisi quantitative di fenomeni socio-economici con l'ausilio del pacchetto applicativo Stata. Capacità di interpretare e sintetizzare i risultati ottenuti.
4. Capacità di utilizzare gli strumenti analitici acquisiti durante il corso per formulare ipotesi interpretative, ricavarne implicazioni strategiche, valutare autonomamente bontà e rilevanza delle analisi empiriche.

PROGRAMMA

ORE	Lezioni
3	Introduzione, richiami di probabilità e statistica
2	Regressione lineare con un regressore
3	Regressione lineare con regressori multipli
2	Funzioni di regressione non lineari
2	Valutazione di studi basati sulla regressione multipla
2	Nozioni di base della regressione lineare con dati longitudinali e della regressione con variabile dipendente binaria
2	Regressione con variabili strumentali
ORE	Laboratori
2	Stata: introduzione, manipolazione dei dati
2	Stata: stima e validazione di modelli di regressione lineare per dati cross-sezionali
2	Stata: esempi di studi basati sulla regressione multipla
2	Stata: regressione lineare con dati longitudinali
2	Stata: regressione con variabile dipendente binaria
2	Stata: regressione con variabili strumentali

MODULO MACROECONOMETRIA

Prof.ssa IOLANDA LO CASCIO

TESTI CONSIGLIATI

Hill R.C., Griffiths W.E., Lim G. C. (2013) Principi di Econometria , Zanichelli.
 Marcellino M. (2006), Econometria applicata:un'introduzione, Egea.
 Dispense del corso (esercitazioni e materiale didattico integrativo)
 Cappuccio N., Orsi R. (2011),Introduzione all' Econometria, Giappichelli Editore
 Stock J.H, M.W. Watson (2016), Introduzione all'Econometria, Pearson,
 Prentice Hall.
 Pastorello S.,(2001) Rischio e Rendimento. Teoria finanziaria e applicazioni
 Econometriche, Il Mulino

TIPO DI ATTIVITA'	C
AMBITO	10705-Attività formative affini o integrative
NUMERO DI ORE RISERVATE ALLO STUDIO PERSONALE	49
NUMERO DI ORE RISERVATE ALLE ATTIVITA' DIDATTICHE ASSISTITE	26

OBIETTIVI FORMATIVI DEL MODULO

Il corso si propone di introdurre lo studente alla comprensione e all'impiego delle principali metodologie di analisi econometrica .
 Alla fine del corso lo studente sara' in grado, tramite l'utilizzo di dati simulati e dati macroeconomici e finanziari, di: 1) impostare e specificare delle equazioni di stima, attraverso l'individuazione delle variabili esogene ed endogene al modello; 2) di testare delle ipotesi suggerite dalla teoria economica e finanziaria; 3) di elaborare e valutare un progetto empirico

PROGRAMMA

ORE	Lezioni
4	Modelli dinamici: specificazione, stima, inferenza e controllo diagnostico; Modelli con variabile dipendente ritardata; modelli a ritardi distribuiti; Autocorrelazione e non corretta specificazione
4	Uso del trend nella regressione; Stime con variabili non stazionarie; Cointegrazione. Modello a Correzione dell'Errore
4	Cenni sui modelli multiequazionali:Modelli per dati Panel: Modello SUR
4	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 bonta' esplicativa del modello.
ORE	Laboratori
12	Applicazioni economiche e finanziarie di modelli uniequazionali dinamici