UNIVERSITÀ DEGLI STUDI DI PALERMO

DIPARTIMENTO	Scienze Economiche, Aziendali e Statistiche
ANNO ACCADEMICO OFFERTA	2022/2023
ANNO ACCADEMICO EROGAZIONE	2024/2025
CORSO DILAUREA	ECONOMIA E FINANZA
INSEGNAMENTO	ECONOMETRIA
TIPO DI ATTIVITA'	C
AMBITO	10705-Attività formative affini o integrative
CODICE INSEGNAMENTO	02694
SETTORI SCIENTIFICO-DISCIPLINARI	SECS-P/05
DOCENTE RESPONSABILE	DE LUCA GIUSEPPE Professore Associato Univ. di PALERMO
ALTRI DOCENTI	
CFU	6
NUMERO DI ORE RISERVATE ALLO STUDIO PERSONALE	94
NUMERO DI ORE RISERVATE ALLA DIDATTICA ASSISTITA	56
PROPEDEUTICITA'	
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

DOCENTE: Prof. GIUSEPPE DE LUCA

PREREQUISITI	Il corso richiede la conoscenza di base di matematica, statistica descrittiva e inferenziale.
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 socio-economici e finanziari di interesse. Lo studente sara' capace di specificare dei modelli adeguati allo studio empirico di teorie e fenomeni socio-economici e finanziari, comprendere le assunzioni necessarie per la specificazione dei diversi modelli, scegliere e confrontare le metodologie di analisi più adeguate, validare le proprietà e l'adeguatezza delle procedure inferenziali utilizzate. 2) Capacita' di applicare conoscenza e comprensione. Tramite le esercitazioni in aula, i laboratori e i compiti di natura applicata assegnati durante il corso, lo studente sara' in grado di condurre analisi empiriche (stime e previsioni) 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 interpretare e presentare i risultati delle analisi econometriche e di giustificarne la validita' empirica alla luce della teoria statistica, econometrica ed economica. 5) Capacita' di apprendimento. Il corso consente allo studente di comprendere i concetti di base dell'econometria e fornisce gli strumenti necessari per la realizzazione di ricerche nel campo dell'econometria applicata.
VALUTAZIONE DELL'APPRENDIMENTO	La verifica dell'apprendimento avviene attraverso una prova scritta e una prova orale. Durante lo svolgimento del corso gli studenti riceveranno dei compiti di natura applicata da svolgere con il software econometrico Stata che contribuiscono alla valutazione finale dell'apprendimento. La commissione giudicatrice sara' presieduta dal docente titolare dell'insegnamento e da almeno un altro docente (Professore o Ricercatore del medesimo o affine settore disciplinare o un cultore della materia). PROVA SCRITTA La prova scritta di fine corso mira ad esaminare conoscenze e abilita' acquisite dallo studente su tutti gli argomenti del corso, nonche' la sua capacita' di riportarle in un elaborato scritto che tenga conto anche della proprieta' di linguaggio e degli aspetti formali. La prova, della durata massima di 2 ore, prevede 2 quesito di natura teorica, 1 quesito di natura empirica e delle domande di natura applicata sul software Stata. Ogni quesito è articolato in piu' sottopunti con un diverso grado di difficoltà che prevedono la dimostrazione delle proprietà teoriche delle procedure inferenziali come stima, verifica di ipotesi e intervalli di confidenza. Per il raggiungimento della soglia di sufficienza si valutera' la conoscenza e la padronanza dei problemi trattati in econometria e delle relative metodologie di analisi, nonche' l'adeguatezza della terminologia utilizzata dallo studente. PROVA ORALE La prova orale di fine corso e' svolta a discrezione della commissione giudicatrice qualora questa ritiene che gli elementi acquisiti durante la prova scritta siano ancora insufficienti per esprimere la valutazione finale dell'esame. Questa prova mira ad approfondire, se ritenuto necessario, la valutazione delle conoscenze, abilita' acquisite dallo studente, nonche' la sua capacita' di esposizione. La prova orale, della durata massima di 15 minuti, puo' consistere in 1-2 domande di natura teorica e/o pratica su tutti gli argomenti del corso. Per il raggiungimento della soglia di sufficienza si valutera' la conoscenza e la padronanza dei argomenti trattati nel corso e delle relative metodologie di analisi, nonche' l'adeguatezza della terminologia utilizzata dallo studente. VALUTAZIONE FINALE La valutazione finale dell'esame prendera' in considerazione quattro aspetti: i) la padronanza degli argomenti; ii) la capacita' di applicazione delle conoscenze acquisite su software Stata (valutate anche tramite i compiti di natura applicata svolti durante il corso); iii) la proprieta' di linguaggio; iv) la partecipazione attiva alle lezioni e le esercitazioni di laboratorio.
OBIETTIVI FORMATIVI	1. Possedere un glossario di base della terminologia econometrica e statistica. 2. Conoscere le principali metodologie utilizzate per l'analisi di fenomeni socio-

	economici e finanziari, le assunzioni sottostanti la specificazione, stima e validazione di un modello di regressione lineare e le sue generalizzazioni, le proprieta' teoriche delle varie procedure inferenziali. 3. Capacita' di elaborare dati reali e svolgere autonomamente analisi quantitative di fenomeni socio-economici e finanziari con l'ausilio del pacchetto applicativo Stata. Capacita' di interpretare e sintetizzare i risultati ottenuti. 4. Capacita' di utilizzare gli strumenti analitici acquisiti durante il corso per formulare ipotesi interpretative, ricavarne implicazioni strategiche, valutare autonomamente e criticamente la bonta' e la rilevanza degli studi empirici.
ORGANIZZAZIONE DELLA DIDATTICA	Lezioni frontali ed esercitazioni empiriche con il software Stata.
TESTI CONSIGLIATI	Il testo di riferimento è: Stock J.H. & Watson M.W. (2020), Introduzione all'Econometria (quinta edizione), Pearson Education Italia. Altre dispense e ariticoli di letteratura verranno fornite durante il corso. Altri utili riferimenti bibliografici sono: Wooldridge J.M. (2012), Introductory Econometrics. A Modern Approach (5th Ed.), South-Western Cengage Learning. Peracchi F. (1995), Econometria, McGraw-Hill Italia. Angrist J.D. e Pischke J.S. (2009), Mostly Harmless Econometrics, Princeton University Press. Hansen B.E. (2018), Econometrics, unpublished manuscript. Greene (2003), Econometric Analysis, Pearson Education. Verbeek M. (2006), Econometria, Zanichelli.

PROGRAMMA

ORE	Lezioni
5	Introduzione, richiami di probabilità, statistica ed algebra matriciale
3	Modello di regressione lineare con un regressore
5	Modello di regressione lineare con regressori multipli
3	Funzioni di regressione non lineari
4	Valutazione di studi basati sulla regressione multipla
4	Modelli di regressione statici per dati panel
4	Regressioni con variabili strumentali
3	Modelli di regressione per variabili dipendenti binarie
3	Regressioni temporali e previsioni
3	Stima di effetti casuali dinamici
3	Ulteriori sviluppi nell'abito delle regressioni temporali

ORE	Esercitazioni
4	Stata: Introduzione
2	Stata: regressioni lineari per dati sezionali
2	Stata: modelli di regressione per dati panel
2	Stata: regressioni per dati in serie temporale
2	Stata: regressioni con variabili strumentali