



UNIVERSITÀ DEGLI STUDI DI PALERMO

DIPARTIMENTO	Scienze Economiche, Aziendali e Statistiche
ANNO ACCADEMICO OFFERTA	2023/2024
ANNO ACCADEMICO EROGAZIONE	2025/2026
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'	23596 - STATISTICA 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

PREREQUISITI	Il corso richiede la conoscenza di base di matematica, statistica descrittiva e inferenziale.
RISULTATI DI APPRENDIMENTO ATTESI	<p>1) Conoscenza e capacità di comprensione. Il corso fornisce agli studenti gli strumenti econometrici di base per le analisi empiriche di problemi socioeconomici basate su dati sezionali, dati in serie temporale e dati longitudinali. Gli studenti apprenderanno come specificare dei modelli che siano adeguati agli scopi inferenziali di interesse e alla struttura dei dati disponibili, come valutare la plausibilità delle assunzioni richieste dalle diverse procedure, come implementare i metodi inferenziali studiati nel software Stata, come interpretare i risultati della loro ricerca empirica, e come valutare la precisione e la robustezza delle loro stime.</p> <p>2) Capacità di applicare conoscenza e comprensione. Gli studenti apprenderanno come condurre un'analisi empirica robusta di diversi fenomeni economici.</p> <p>3) Autonomia di giudizio. Gli studenti apprenderanno come valutare criticamente le implicazioni di natura economica dei loro risultati empirici.</p> <p>4) Abilità comunicative. Gli studenti apprenderanno come interpretare e sintetizzare i risultati delle loro analisi empiriche attraverso l'utilizzo di grafici e tabelle.</p> <p>5) Capacità di apprendimento. Il corso fornirà agli studenti i concetti di base dell'econometria teorica e gli strumenti necessari per la realizzazione di ricerche empiriche in econometria ed economia applicata.</p>
VALUTAZIONE DELL'APPRENDIMENTO	<p>La verifica dell'apprendimento avviene attraverso una prova scritta e una prova orale. Durante il corso gli studenti svolgeranno esercizi di natura teorica e problemi empirici con il software Stata. La partecipazione attiva alle lezioni e alle altre attività del corso (esercitazioni teoriche e pratiche nel software Stata) possono contribuire alla valutazione finale dell'apprendimento.</p> <p>PROVA SCRITTA</p> <p>La prova scritta esamina le conoscenze, abilità e proprietà di linguaggio acquisite dagli studenti su tutti gli argomenti del corso. La prova scritta ha una durata di circa 2 ore ed include domande sulle proprietà teoriche dei metodi inferenziali usati in econometria, le loro applicazioni a problemi reali e la loro implementazione in Stata. La commissione valuterà la completezza delle risposte fornite ai vari quesiti e la validità dei sottostanti metodi di prova e analisi. Per superare questa prova, lo studente deve mostrare una conoscenza sufficiente dei metodi inferenziali usati in econometria e della loro applicazione a problemi di natura empirica.</p> <p>PROVA ORALE</p> <p>Per accedere alla prova orale è necessario superare la prova scritta. Questa parte dell'esame mira ad approfondire la valutazione delle conoscenze, delle abilità e della capacità di esposizione acquisite dallo studente. La prova orale ha una durata circa 15 minuti e consiste di domande su tutti gli argomenti del corso e problemi che non sono stati risolti appropriatamente durante la prova scritta. Si valuterà la conoscenza e la padronanza degli argomenti trattati nel corso, le metodologie teoriche di prova e analisi, e l'adeguatezza della terminologia. Per il raggiungimento della soglia di sufficienza, lo studente deve mostrare una conoscenza sufficiente dei metodi inferenziali usati in econometria e la loro applicazione a problemi di natura empirica.</p> <p>VALUTAZIONE FINALE</p> <p>La valutazione finale dell'esame prenderà in considerazione cinque aspetti: i) padronanza degli argomenti trattati; ii) metodologie teoriche di prova e analisi; iii) applicazione delle conoscenze acquisite a problemi reali di natura empirica, anche con l'ausilio del software Stata; iv) proprietà di linguaggio; v) partecipazione attiva alle lezioni e alle altre attività del corso.</p>
OBIETTIVI FORMATIVI	<ol style="list-style-type: none"> 1. Possedere un glossario di base della terminologia econometrica. 2. Conoscere i principali metodi inferenziali per la ricerca applicata in economia. 3. Analisi di dati economici reali con l'ausilio del pacchetto applicativo Stata. 4. Interpretazione di risultati empirici. 5. Utilizzo di strumenti analitici per formulare ipotesi interpretative, ricavare

	implicazioni strategiche, e valutare la validità di studi empirici.
ORGANIZZAZIONE DELLA DIDATTICA	Lezioni frontali, esercitazioni di teoria econometrica, ed esercitazioni empiriche con il software Stata.
TESTI CONSIGLIATI	<p>Il testo di riferimento è:</p> <p>Stock J.H. & Watson M.W. (2020), Introduzione all'Econometria (quinta edizione), Pearson Education Italia.</p> <p>Altre dispense e articoli di letteratura verranno fornite durante il corso. Altri utili riferimenti bibliografici sono:</p> <p>Wooldridge J.M. (2012), Introductory Econometrics. A Modern Approach (5th Ed.), South-Western Cengage Learning.</p> <p>Peracchi F. (1995), Econometria, McGraw-Hill Italia.</p> <p>Angrist J.D. e Pischke J.S. (2009), Mostly Harmless Econometrics, Princeton University Press.</p> <p>Hansen B.E. (2018), Econometrics, unpublished manuscript.</p> <p>Greene (2003), Econometric Analysis, Pearson Education.</p> <p>Verbeek M. (2006), Econometria, Zanichelli.</p>

PROGRAMMA

ORE	Lezioni
4	Introduzione, richiami di probabilità e statistica
3	Modello di regressione lineare con un regressore
2	Modello di regressione lineare con regressori multipli (notazione scalare)
2	Modello di regressione lineare con regressori multipli (notazione matriciale)
3	Funzioni di regressione non lineari
4	Valutazione di studi basati sulla regressione multipla
3	Modelli di regressione statici per dati panel
3	Regressioni con variabili strumentali
3	Modelli di regressione per variabili dipendenti binarie
3	Regressioni temporali e previsioni
2	Stima di effetti casuali dinamici
ORE	Esercitazioni
2	Esercitazione sui richiami di probabilità e statistica
3	Stata: regressioni lineari per dati sezionali
2	Richiami ed esercitazione di algebra matriciale
3	Esercitazione sul modello di regressione lineare multipla
2	Esercitazione sulla violazione delle assunzioni dei minimi quadrati
3	Stata: modelli di regressione per dati panel
3	Stata: regressioni con variabili strumentali
3	Stata: regressioni logit e probit
3	Stata: regressioni per dati in serie temporale