

<b>STRUTTURA</b>	Scuola Politecnica
<b>ANNO ACCADEMICO</b>	2014/2015
<b>CORSO DI LAUREA MAGISTRALE</b>	Scienze Statistiche LM-82
<b>INSEGNAMENTO</b>	Econometria
<b>TIPO DI ATTIVITÀ</b>	B: Caratterizzante
<b>AMBITO DISCIPLINARE</b>	Statistico applicato
<b>CODICE INSEGNAMENTO</b>	02694
<b>ARTICOLAZIONE IN MODULI</b>	NO
<b>SETTORI SCIENTIFICO DISCIPLINARI</b>	SECS-P/05
<b>DOCENTE RESPONSABILE</b>	Iolanda Lo Cascio Ricercatore Università degli studi di Palermo
<b>CFU</b>	6
<b>NUMERO DI ORE RISERVATE ALLO STUDIO PERSONALE</b>	105
<b>NUMERO DI ORE RISERVATE ALLE ATTIVITÀ DIDATTICHE ASSISTITE</b>	45 (27 ore lezioni frontali + 18 ore esercitazioni)
<b>PROPEDEUTICITÀ</b>	Nessuna
<b>ANNO DI CORSO</b>	Primo
<b>SEDE DI SVOLGIMENTO DELLE LEZIONI</b>	Consultare il sito <a href="http://www.politecnica.unipa.it">www.politecnica.unipa.it</a>
<b>ORGANIZZAZIONE DELLA DIDATTICA</b>	Lezioni frontali, Esercitazioni in aula, Esercitazioni in laboratorio.
<b>MODALITÀ DI FREQUENZA</b>	Facoltativa
<b>METODI DI VALUTAZIONE</b>	Prova Orale
<b>TIPO DI VALUTAZIONE</b>	Voto in trentesimi
<b>PERIODO DELLE LEZIONI</b>	Consultare il sito <a href="http://www.politecnica.unipa.it">www.politecnica.unipa.it</a>
<b>CALENDARIO DELLE ATTIVITÀ DIDATTICHE</b>	Consultare il sito <a href="http://www.politecnica.unipa.it">www.politecnica.unipa.it</a>
<b>ORARIO DI RICEVIMENTO DEGLI STUDENTI</b>	Consultare la pagina personale del docente

## **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 econometria, 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.

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.

<b>ORE</b>	<b>LEZIONI FRONTALI</b>
5	Richiami sul modello di regressione lineare; Instabilità dei parametri del modello lineare; Break strutturali e test per la loro presenza
2	Modelli dinamici: specificazione, stima, inferenza e controllo diagnostico; Modelli con variabile dipendente ritardata
2	Uso del trend nella regressione; Stime con variabili non stazionarie; Cointegrazione.
4	Specificazione dinamica di un modello uniequazionale; Modelli a ritardi distribuiti; Autocorrelazione e non corretta specificazione 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 in modelli multivariati; esogeneità e causalità in modelli multiequazionali dinamici.
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.
	<b>ESERCITAZIONI</b>
18	Applicazioni economiche e finanziarie di modelli uniequazionali dinamici
<b>TESTI CONSIGLIATI</b>	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.