

FACOLTÀ	Economia
ANNO ACCADEMICO	2009/2010
CORSO DI LAUREA MAGISTRALE	Scienze Statistiche
INSEGNAMENTO	Econometria
TIPO DI ATTIVITÀ	Caratterizzante.
AMBITO DISCIPLINARE	Statistico-Applicato
CODICE INSEGNAMENTO	02694
ARTICOLAZIONE IN MODULI	NO
SETTORI SCIENTIFICO DISCIPLINARI	SECS-P/05
DOCENTE	Iolanda Lo Cascio
RESPONSABILE	Ricercatore Università di Palermo
CFU	6
NUMERO DI ORE RISERVATE ALLO STUDIO PERSONALE	114
NUMERO DI ORE RISERVATE ALLE ATTIVITÀ DIDATTICHE ASSISTITE	36
PROPEDEUTICITÀ	
ANNO DI CORSO	Primo
SEDE DI SVOLGIMENTO DELLE LEZIONI	Da definire
ORGANIZZAZIONE DELLA DIDATTICA	Lezioni frontali, Esercitazioni in aula.
MODALITÀ DI FREQUENZA	Facoltativa
METODI DI VALUTAZIONE	Prova Scritta
TIPO DI VALUTAZIONE	Voto in trentesimi
PERIODO DELLE LEZIONI	Secondo semestre
CALENDARIO DELLE ATTIVITÀ DIDATTICHE	Da definire
ORARIO DI RICEVIMENTO DEGLI STUDENTI	Da definire

RISULTATI DI APPRENDIMENTO ATTESI

Conoscenza e capacità di comprensione

Acquisizione di metodi statistici e matematici volti allo studio e alla misurazione dei fenomeni economici.
Familiarità col modello lineare classico e sue generalizzazioni e coi relativi metodi di stima.

Capacità di applicare conoscenza e comprensione

Utilizzo di strumenti econometrici, di carattere univariato e/o multivariato, lineare e non lineare, atti a : 1. fornire evidenza a supporto della validità delle teorie economiche e finanziarie; 2. avanzare previsioni sull'andamento futuro delle variabili economiche e finanziarie; 3. costruire 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 precedentemente accertata tramite batterie di tests di specificazione.

Capacità d'apprendimento

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

OBIETTIVI FORMATIVI

Obiettivo del corso e' quello di illustrare le principali metodologie di analisi econometrica 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 approfondisce alcuni aspetti dei metodi econometrici con riferimento ai modelli di regressione univariati e multivariati come i modelli autoregressivi vettoriali (VAR). Ai fini dell'interpretazione e della previsione della varianza condizionata di una determinata tipologia di serie storiche vengono introdotti alcuni strumenti metodologici, quali i modelli lineari per la stima e la previsione della volatilità. In aggiunta agli aspetti teorico-metodologici, ampio spazio e' dato ad applicazioni tratte dalla teoria macroeconomica e a problematiche di natura finanziaria.

ORE FRONTALI

LEZIONI FRONTALI

8	Il modello di regressione lineare classico; minimi quadrati ordinari sotto condizioni piu' generali.
8	Il metodo della massima verosimiglianza: definizione, matrice di informazione, proprieta' asintotiche nei modelli correttamente specificati; confronto tra modelli annidati; test basati sulla verosimiglianza
12	Modelli VAR stazionari e non stazionari; cointegrazione e approccio di Johansen ; VAR strutturali
6	Modelli non lineari per la stima e previsione della volatilità: ARCH e GARCH

ESERCITAZIONI

8	Proprieta' di stimatori e tests.
6	Applicazioni economiche e finanziarie.

TESTI CONSIGLIATI

Cavaliere, G., Costa, M., Fanelli, L., Gardini, A.(2000),*Econometria ,Vol I e Vol. II*, Franco Angeli, Milano.
Gallo, G.M., B. Pacini (2002),*Metodi Quantitativi per i mercati finanziari*, Carocci.
Favero, C.A. (1998), *ECONOMETRIA. Modelli e applicazioni in macroeconomia*, Carocci.