



# UNIVERSITÀ DI PISA

---

## INTRODUZIONE ALL'ECONOMETRIA

**ANGELA PARENTI**

Anno accademico 2020/21  
CdS ECONOMIA E COMMERCIO  
Codice 223PP  
CFU 9

Moduli	Settore/i	Tipo	Ore	Docente/i
INTRODUZIONE ALL'ECONOMETRIA	SECS-P/05	LEZIONI	63	ANGELA PARENTI

### Obiettivi di apprendimento

#### *Conoscenze*

L'obiettivo di Introduzione all'Econometria è quello di fornire un'introduzione all'econometria mediante un approccio prevalentemente applicato. Sebbene siano trattati sia gli aspetti teorici che quelli pratici, l'accento è posto sulla comprensione intuitiva dei concetti chiave delle tecniche econometriche illustrati con applicazioni empiriche aventi ad oggetto questioni economiche rilevanti nel dibattito di policy.

#### *Modalità di verifica delle conoscenze*

Per l'accertamento delle conoscenze saranno svolte delle prove in itinere.

#### *Capacità*

Al termine del corso lo studente dovrà essere in grado di svolgere autonomamente un'analisi empirica, interpretare i risultati delle proprie analisi così come quelle di altri. Inoltre, dovrà essere in grado di valutare l'adeguatezza delle ipotesi alla base di tali interpretazioni.

#### *Modalità di verifica delle capacità*

Circa un terzo delle lezioni saranno dedicate alle applicazioni empiriche degli strumenti econometrici e richiederanno l'utilizzo di un software statistico. In questo corso useremo R.

R è un software libero (viene distribuito con la licenza GNU GPL) ed è disponibile per i più importanti sistemi operativi (Unix, GNU/Linux, macOS, Microsoft Windows).

Agli studenti non è richiesto di avere alcuna conoscenza di R.

#### *Comportamenti*

Saranno acquisite opportune accuratezza e precisione nello svolgere attività di raccolta di dati e nell'analisi econometrica.

#### *Modalità di verifica dei comportamenti*

Durante le sessioni di laboratorio saranno valutati il grado di accuratezza e precisione delle attività svolte.

#### *Prerequisiti (conoscenze iniziali)*

E' richiesta una conoscenza base delle nozioni di statistica.

#### *Indicazioni metodologiche*

Lezioni frontali ed esercitazioni in laboratorio.

#### *Programma (contenuti dell'insegnamento)*

1. Richiami di probabilità e statistica
2. Regressione lineare con un singolo regressore
3. Regressione con un singolo regressore: verifica di ipotesi e intervalli di confidenza
4. Regressione lineare con regressori multipli
5. Verifica di ipotesi e intervalli di confidenza nella regressione multipli



## UNIVERSITÀ DI PISA

---

6. Funzioni di regressioni non lineari
7. Valutazione di studi basati sulla regressione multipla
8. Regressione con variabile dipendente binaria
9. Regressione con variabili strumentali
10. Regressione con dati panel

### Bibliografia e materiale didattico

Stock, J. H. e Watson, M.W: Introduzione all'econometria, Pearson Italia, 2005.

### Modalità d'esame

#### **EMERGENZA COVID19:**

Vista le modalite di insegnamento remoto, per gli appelli della sessione estivi il voto finale consiste:

- 1) Homework
- 2) Esami scritto in modalita' remota
- 3) Esame orale (verifica della prova scritta)

Queste tre componenti costituiranno il voto finale. Il voto degli homework verra' mantenuto fino e non oltre la sessione di settembre.

Per gli studenti che non hanno consegnato gli homework, il voto finale consistera' esclusivamente della componente scritta e orale.

### Note

#### **Orario lezioni**

Mercoledì: 10:30-12:00

Giovedì: 10:30-12:00

Venerdì: 8:45-10:15

#### **Ricevimento:**

Parenti: Lun: 11:00-12:00

*Ultimo aggiornamento 16/02/2021 11:06*