UNIVERSITÀ DI PISA

ADVANCED ECONOMETRICS

LAURA MAGAZZINI

Academic year	2023/24
Course	ECONOMICS
Code	246PP
Credits	9

Modules	Area	Type	Hours	Teacher(s)
ADVANCED ECONOMETRICS	SECS-P/05	LEZIONI	63	LAURA MAGAZZINI SEBASTIANO MICHELE ZEMA

Obiettivi di apprendimento

Conoscenze
L'obiettivo del corso è quello di fornire agli studenti i principi fondamentali dell'econometria teorica e gli strumenti computazionali utilizzati nell'analisi empirica moderna con particolare enfasi alla stima delle relazioni causali tra le variabili economiche.

Modalità di verifica delle conoscenze
Per l'accertamento delle conoscenze, oltre all'esame finale, saranno svolte delle prove in itinere.

Capacità
Alla fine del corso gli studenti e le studentesse avranno una comprensione critica delle idee alla base della teoria econometrica e saranno in grado di applicare queste idee al mondo reale. Gli studenti e le studentesse inoltre acquisiranno familiarità con il software statistico R e saranno in grado di utilizzarlo per svolgere in modo autonomo un'analisi empirica su dati reali.

Modalità di verifica delle capacità
Alcune lezioni saranno dedicate alle applicazioni empiriche per le quali sarà usato il software statistico R. Durante queste sessioni, saranno presentati molti esempi al fine di far comprendere agli studenti e alle studentesse la giusta specificazione econometrica da utlizzare e la corretta interpretazione dei risultati empirici.

Comportamenti
Frequenza
La frequenza alle lezioni è consigliata, così come una preparazione per una piena partecipazione alla lezione. Gli studenti che hanno problemi possono fare domande durante la lezione o durante l'orario di ricevimento.
Imbrogli o altre forme di disonestà
Non ci saranno tolleranze nei confronti di qualsiasi tipo di imbroglio. Gli studenti che saranno trovati a copiare non supereranno l'esame e il loro comportamento sarà riportato agli uffici competenti.

Modalità di verifica dei comportamenti
Durante le lezioni la partecipazione attiva degli studenti sarà valutata, così come la correttezza del loro comportamento nello svolgimento degli esami.

Prerequisiti (conoscenze iniziali)
Per poter seguire le lezioni teoriche, è richiesta familiarità con i concetti base della probabilità, della statistica e dell'algebra lineare. Il corso include comunque un ripasso dei concetti fondamentali di statistica e probabilità necessari per lo studio della materia. Coloro che non hanno familiarità con questi strumenti dovrebbero riverderli in dettaglio per loro conto. La conoscenza del software R è utile ma non necessaria.
Importante: A chi non avesso mai seguito corsi di introduzione all'econometria è fortemente consigliato di colmare le proprie lacune utilizzando un testo non avanzato, come ad esempio:
Wooldridge, Jeffrey M. Introductory econometrics: A modern approach. Nelson Education, 2016.

Indicazioni metodologiche

Lezioni frontali.

Programma (contenuti dell'insegnamento)

1. Teoria asintotica
2. Il modello di regressione e lo stimatore dei minimi quadrati ordinari
3. Il metodo delle variabili strumentali
4. Modelli per variabile dipendente binaria
5. Modelli per dati panel (longitudinali)

Bibliografia e materiale didattico

Principale libro di testo:

- Wooldridge, J. M.: Introductory Econometrics: A Modern Approach, South-Western Publishing.

Per R:

- Heiss, F.: Using R for Introductory Econometrics (http://www.urfie.net/)

Modalità d'esame

La valutazione sarà effettuata sulla base degli homework, la prova "midterm" e l'esame finale.
Queste tre componenti costituiranno il voto finale; è possibile scegliere tra tre diverse modalità.
1. Esame finale
2. Homework + esame finale
3. Midterm + homework + esame finale

Per gli studenti e le studentesse che non hanno consegnato gli homework, la valutazione si baserà esclusivamente sulla prova finale.

Note

Maggiori dettagli saranno resi disponibili sul sito web dell'orario del corso (https://mse.ec.unipi.it/courses/first-year/) e sul canale Moodle dedicato.

Ultimo aggiornamento 16/02/2024 12:31