



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