# Sistema centralizzato di iscrizione agli esami Programma



## UNIVERSITÀ DI PISA ADVANCED ECONOMETRICS

#### **GIUSEPPE RAGUSA**

Anno accademico 2019/20

CdS ECONOMICS

Codice 246PP

CFU 9

ModuliSettore/iTipoOreDocente/iADVANCEDSECS-P/05LEZIONI63ANGELA PARENTI

ECONOMETRICS GIUSEPPE RAGUSA

#### 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 on una particolare enfasi alla stima delle relazioni causali tra le variabili economiche. Applicazioni sia di microeconomia che di macroeconomia saranno considerate a tal fine.

#### Modalità di verifica delle conoscenze

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

#### Capacità

Alla fine del corso gli studenti dovrebbero avere una comprensione critica delle idee alla base della teoria econometrica e dovrebbero essere in grado di applicare queste idee al mondo reale. Gli studenti inoltre acquisiranno familiarità con il software statistico R che sarà utilizzato durante tutto il corso.

#### Modalità di verifica delle capacità

Alcune lezioni saranno dedicate alle appliazioni empiriche per le quali sarà usato il software statistico R. Durante le sessioni di laboratorio, molti esempi saranno presentati al dine di far comprendere agli studenti 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)

Gli studenti devono essere familiari con i concetti base della probabilità, della statistica e dell'algebra lineare. Il corso include comunque un ripasso di statistica e probabilità. Gli studenti che non hanno familiarità con questi strumenti dovrebbero riverderli in dettaglio per loro conto. **Importante**: 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.

Una conoscenza base del software R è richiesta. Gli studenti che non sono familiari con le funzionalità base di R devono cercare di recuperare il loro gap. A tal fine possono far riferimento al testo Using R for Introductory Econometrics by Florian **Heiss**.

# DICALLAND OF THE PROPERTY OF T

### Sistema centralizzato di iscrizione agli esami

Programma

# Università di Pisa

#### Indicazioni metodologiche

Lezioni frontali ed esercitazioni in laboratorio.

#### Programma (contenuti dell'insegnamento)

- 1. Basic Asymptotic Theory
- 2. Single equation Linear Model and Ordinary Least Squares Estimatioj
- 3. Instrumental Variables of Single Equation Models
- 4. Additional Topics: Generated Regressors, Control function approach
- 5. Basic Linear Unobserved Panel Data Models
- 6. Binary Response Models
- 7. Other Nonlinear Models and estimators
- 8. Special topics: Program Evaluation

#### Bibliografia e materiale didattico

Principale libro di testo:

• Wooldridge, J. M.: Introductory Econometrics: A Modern Approach 5th edition), South-Western Publishing.

Agli studenti saranno anche forniti degli Handout.

Per R:

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

#### Indicazioni per non frequentanti

Tutti gli homoework coterranno sia una parte empirica che una teorica sulla parte svolta durante le lezioni. Gli homework saranno consegnati agli studenti periodocamente e caricati su Moodle. Gli homework saranno 5, 3 prima del midterm e 2 dopo.

#### 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 homowork 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

Lezioni

Mercoledì: 12:15-13:45 (P2) Giovedì: 14:00-15:30 (D1) Venerdì: 12:15-13:45(L2)

Ricevimento: Ragusa: Ven: 10:30-11:30

Parenti: Lun: 11:00-12:00

Ultimo aggiornamento 20/05/2020 17:04