

Nome docente	Paolo Brunori
Corso di laurea	CLEC-CLSS
Anno accademico	2015-2016
Periodo di svolgimento	II semestre
Crediti formativi universitari (CFU)	6
Settore scientifico disciplinare	SECS-P01/P05

Programma di Principi di Econometria (a.a. 2015-2016)
(Prof. Paolo Brunori)

Università degli Studi di Bari Aldo Moro
Corso di Laurea in Economia e Commercio
Corso di Laurea in Scienze Statistiche

Pre-requisiti

Non sono previsti pre-requisiti tuttavia i contenuti fondamentali dei corsi di Microeconomia, Macroeconomia, Statistica I e Statistica II rendono più facile la comprensione di alcune parti del corso.

Obiettivi del corso

L'obiettivo di questo corso è mettere in grado lo studente di interpretare in modo critico i dati economici per ricavarne informazioni utili a capire la realtà. Il corso segue un approccio sia teorico che applicato. L'approccio teorico introduce le proprietà statistiche di alcuni strumenti utilizzati dagli economisti per analizzare i dati. L'approccio applicato prevede che gli studenti imparino a manipolare e interpretare dati economici. Le esercitazioni saranno svolte utilizzando un software gratuito (Gretl), uno strumento in grado di rendere gli studenti autonomi nell'analisi econometrica di base.

Programma

Fondamenti:

1. Utilizzare i dati economici
2. Le correlazioni
3. Introduzione alla stima dei minimi quadrati
4. Utilizzo dei logaritmi per la stima delle elasticità
5. Test delle ipotesi
6. La regressione multipla
7. Problemi di specificazione del modello di regressione

Estensioni:

8. Regressione per variabili dipendenti binarie
9. Eteroschedasticità
10. Autocorrelazione
11. Trend nelle serie storiche

Bibliografia

Libro di testo:

- Stock J.H. e Watson M.W. (2012), "Introduzione all'Econometria", Pearson Education Italia 3/ed. (capitoli 1-11)

Altri testo di riferimento:

- Baddeley M.C. E Barrowclough D.V. (2009), Running Regressions. A practical Guide to Quantitative Reserach in Economics, Finance and Development Studies. Cambridge University Press.
- Gary Koop, (2013), Analysis of Economic Data, 4th Edition, Wiley.
- Documentazione del software Gretl disponibile all'inidirizzo:
<http://gretl.sourceforge.net/it.html>

Modalità di accertamento conoscenze

- Esoneri: No
- Prova Scritta: Si
- Colloquio Orale: No

Forme di assistenza allo studio

- Corso presente nella zona in e-learning del Sito Web di Dipartimento: No
- Saranno rese disponibili sul sito del docente materiali di supporto allo studio

Organizzazione della didattica

- Cicli interni di lezione: No
- Corsi integrativi:No
- Esercitazioni: Si
- Seminari: Si
- Attività di laboratorio: Si facoltativa
- Project work: No
- Visite di studio: No