

<b>Nome docente</b>	Cosimo MAGAZZINO
<b>Corso di laurea</b>	Economia e Management
<b>Anno accademico</b>	2014-2015
<b>Periodo di svolgimento</b>	II Semestre
<b>Crediti formativi universitari (CFU)</b>	6 CFU
<b>Settore scientifico disciplinare</b>	SECS-P/05

### Programma di **Econometria** (a.a. 2014-2015)

(Prof. **MAGAZZINO Cosimo**)

Università degli Studi di Bari Aldo Moro

Corso di Laurea **Economia e Management**

Pre-requisiti

**I contenuti del corso di Statistica**

Obiettivi del corso

L'obiettivo del corso è quello di introdurre lo studente ai concetti dell'analisi econometrica, imparando ad affrontare i casi più rilevanti in cui non sono applicabili direttamente gli strumenti dell'analisi di regressione lineare classica. Tra gli esempi più rilevanti di violazione delle assunzioni classiche verranno considerati il caso di errori non omoschedastici, non indipendenti, non ortogonali, e di errori di misura. Gli argomenti verranno presentati facendo un uso estensivo del software statistico-econometrico STATA, per conseguire una migliore comprensione dei concetti discussi, e per introdurre lo studente alla pratica delle tecniche di stima e di validazione basata su modelli computazionali.

Programma

#### PARTE 1: INTRODUZIONE E RICHIAMI

- Domande economiche e dati economici
- Richiami di matematica, probabilità e statistica

#### PARTE 2: ELEMENTI FONDAMENTALI DELL'ANALISI DI REGRESSIONE

- Regressione lineare con un singolo regressore
- Regressione con un singolo regressore: verifica di ipotesi e intervalli di confidenza
- Regressione lineare con regressori multipli
- Verifica di ipotesi e intervalli di confidenza nella regressione multipla
- Funzioni di regressioni non lineari
- Valutazione di studi basati sulla regressione multipla

#### PARTE 3: ULTERIORI SVILUPPI DELL'ANALISI DI REGRESSIONE

- Regressione con dati panel
- Regressione con variabile dipendente binaria
- Regressione con variabili strumentali

Bibliografia

- C. Magazzino, *Precorso di Matematica*, McGraw-Hill, 2013.
- J.H. Stock, M.W. Watson, *Introduzione all'econometria*, 3/Ed., Pearson, 2012 (capp. 1-12).
- P.H. Franses, *Breve introduzione all'econometria*, il Mulino, 2004.
- Dispense a cura del docente.

#### Modalità di accertamento conoscenze

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

#### Forme di assistenza allo studio

- Corso presente nella zona in e-learning del Sito Web di Facoltà: No

#### Organizzazione della didattica

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