

ECONOMETRIA

Docente/i: LEOMBRUNI ROBERTO
Settore: SECS-P/05
CFU: 6
Sede: TORINO

PROGRAMMA D'ESAME A.A.: 2010-2011

Obiettivi

Introdurre lo studente ai concetti, alla teoria e alla pratica econometrici, portandolo a:

1. Capire la relazione tra teorie/modelli economici e dati empirici sui quali verificarle;
2. Interpretare le relazioni tra una variabile 'da spiegare' (dipendente) e una o più variabili 'che spiegano' (indipendenti);
3. Svolgere una analisi di regressione ordinaria, interpretandone i risultati;
4. Effettuare semplici esperimenti Monte Carlo per approfondire i concetti affrontati.

Risultati dell'apprendimento

Programma

1. I dati economici: tipologia e fonti;
2. Come 'interrogare' i dati: che cos'è uno stimatore e quali sono le sue proprietà;
3. Relazioni tra variabili e causalità;
4. Tecniche a confronto: come stimare la relazione tra una variabile 'da spiegare' e una 'che spiega'?
5. Lo stimatore a minimi quadrati ordinari della funzione di regressione univariata;
6. Il coefficiente R^2 e sua interpretazione;
7. Intervalli di confidenza delle stime;
8. Stima a minimi quadrati di una funzione di regressione multipla;
9. Multicollinearità;
10. Test di ipotesi su coefficienti singoli e su insiemi di coefficienti;
11. Variabili 'dummy' per lo studio di fenomeni qualitativi.

Testi Consigliati

Stock J.H., Watson M.W., Introduzione all'econometria, Pearson Education Italia, Milano

Edizione 2005: capitoli 1-5, 11

Edizione 2009: capitoli 1-7, 13

Altri materiali utilizzati (dispense ed esercitazioni) saranno disponibili on-line nella pagina del corso

Modalità Didattiche

Lezioni teorico-pratiche ed esercitazioni in aula computer, utilizzando il software statistico SAS®

Modalità di Esame

Esame scritto con domande teoriche a risposta chiusa ed esercizi (non al computer, ma è utile una calcolatrice), con libro, dispense, appunti aperti.
Orale facoltativo.

Note