



[1664] - ECONOMETRIA

Informazioni generali

Corso di studi	ECONOMIA, BANCA E FINANZA
Tipo di corso	Corso di Laurea
Anno di offerta	2025/2026
Anno di corso	3
Tipo Attività Formativa	Caratterizzante
Ambito	Economico
Lingua di erogazione	ITALIANO
Crediti	6 CFU
Tipo attività didattica	Lezione
Tipo esame	Orale
Valutazione	Voto Finale
Periodo didattico	Secondo Semestre (dal 23/02/2026 al 29/05/2026)
Titolari	FORGIONE ANTONIO FABIO
Durata	36 ore (36 ore Lezione)
Frequenza	Non obbligatoria
Settore scientifico disciplinare	SECS-P/05
Sede	MESSINA

Obiettivi formativi

L'obiettivo del corso è fornire agli studenti una gamma di diverse tecniche econometriche, che costituiscono parte essenziale di ogni analisi empirica rigorosa. Il corso focalizzerà sulle applicazioni rese possibili da ogni metodologia introdotta, piuttosto che finalizzare l'analisi esclusivamente alla metodologia. In particolare, la gran parte del corso sarà basata sull'analisi del modello di regressione lineare e le relative assunzioni sottostanti. Si approfondirà la stima dei parametri con il metodo dei minimi quadrati, e si studieranno le conseguenze sugli stimatori della violazione empirica di ciascuna delle assunzioni relative al modello lineare.

Prerequisiti

Conoscenza di concetti base di statistica, probabilità e matematica.

Contenuti

Introduzione al corso di Econometria. Effetti causali ed esperimenti idealizzati; Fonti, tipi e classificazione dei dati. Regressione lineare con un singolo regressore: Stima dei coefficienti del modello di regressione lineare; misure di bontà dell'adattamento e di accuratezza delle predizioni; Le assunzioni OLS per l'inferenza causale; La distribuzione campionaria degli stimatori OLS; Verifica di ipotesi e intervalli di confidenza. L'errore standard della stima OLS; Verifica di ipotesi riguardanti la stima OLS; Intervalli di confidenza per la stima OLS. Regressioni con covariate binarie; eteroschedasticità ed omoschedasticità; efficienza degli OLS. Regressione lineare con regressori multipli. Distorsione da variabili omesse; causalità e analisi di regressione. Regressione multipla e OLS; Misure di bontà dell'adattamento; Distribuzione campionaria dello stimatore OLS con regressori multipli; Variabili di controllo. Verifica di ipotesi e intervalli di confidenza nella regressione multipla. Verifica di ipotesi e intervalli di confidenza per un singolo coefficiente; verifica di ipotesi congiunte su più coefficienti; altri tipi di ipotesi riguardanti più coefficienti. Specificazione di un modello di regressione. Funzioni di regressione non lineari. Funzioni non lineari a una variabile (polinomi e logaritmi); interpretazione dei coefficienti. Funzioni lineari a due variabili: interazioni (variabili binarie; binaria-continua; continua-continua); interpretazione dei coefficienti. Valutazione di studi basati sulla regressione multipla. Validità interna ed esterna. Minacce alla validità interna: a) distorsione da variabili omesse; b) incorretta specificazione della forma funzionale; c) distorsione da errore nelle variabili; d) distorsione da dati mancanti e da selezione campionaria; e) distorsione da causalità simultanea. Regressione con dati panel. Regressione con effetti fissi. Regressione con effetti temporali; Errori standard per regressione con effetti fissi. Regressione con variabile dipendente binaria. Modello lineare di probabilità; Regressione con modello probit. Regressione con modello logit; Stima e inferenza nei modelli logit e probit. Regressione con variabili strumentali. Modello con un singolo regressore endogeno ed un solo strumento. Il modello generale di regressione IV; verifica della validità degli strumenti.

Metodi didattici

Lezioni frontali

Verifica dell'apprendimento

Esame orale

Testi

James H. Stock, Mark W. Watson. Introduzione all'econometria 5/ed. Pearson