

insegnamento	Introduzione all'Econometria
Tipo	opzionale
Livello e Corso di Studio	Laurea Triennale in Economia dei mercati e degli intermediari finanziari L-33
Anno di corso	Secondo o terzo anno
Semestre e modulo	Secondo semestre, primo modulo
Numero di crediti	6 CFU
Propedeuticità	Macroeconomia, Microeconomia, Statistica
Docente Cognome Nome Dipartimento Stanza Telefono Email Orario di ricevimento Link a curriculum	Franco Peracchi Dipartimento di Economia e Finanza Stanza P1 B3-7 Telefono 06 7259 5934 <a href="mailto:franco.peracchi@uniroma2.it">franco.peracchi@uniroma2.it</a> martedì 9.30–11.30 (o su appuntamento) <a href="http://www.economia.uniroma2.it/nuovo/facolta/docenti/curriculum.asp?idProfessore=122">http://www.economia.uniroma2.it/nuovo/facolta/docenti/curriculum.asp?idProfessore=122</a>
Obiettivi di apprendimento del corso:	Introdurre gli studenti alla ricerca empirica in campo economico. Alla fine del corso lo studente conoscerà i principali metodi di regressione utilizzati per l'analisi di dati di tipo economico e come utilizzarli nella ricerca empirica. In particolare, il corso intende fornire la capacità di sviluppare tutte le fasi del processo di analisi volta alla stima di effetti causali: scelta del modello statistico, tecniche di inferenza più opportune alla luce della natura dei dati a disposizione, e valutazione dei risultati e loro interpretazione.
Programma del corso	Il programma si articola nei seguenti argomenti principali:  <ol style="list-style-type: none"> <li>1. Introduzione.</li> <li>2. Richiami di probabilità e statistica.</li> <li>3. Regressione lineare con un singolo regressore.</li> <li>4. Regressione con un singolo regressore: verifica di ipotesi e intervalli di confidenza.</li> <li>5. Regressione lineare con regressori multipli.</li> <li>6. Verifica di ipotesi e intervalli di confidenza nella regressione multipla.</li> <li>7. Funzioni di regressione nonlineari.</li> <li>8. Valutazione di studi basati sulla regressione multipla.</li> <li>9. Regressione con dati panel.</li> <li>10. Regressione con variabile dipendente binaria.</li> <li>11. Regressione con variabili strumentali.</li> <li>12. Esperimenti e quasi esperimenti.</li> <li>13. Introduzione alla regressione con serie storiche.</li> <li>14. Stima di effetti causali dinamici.</li> </ol> Costituiscono parte integrante del corso gli incontri settimanali di discussione degli esercizi assegnati
Materiali di studio	Il testo di riferimento è: <ul style="list-style-type: none"> <li>• Stock J.H. e Watson M.W. (2012), Introduzione all'Econometria (terza edizione), Pearson Education Italia.</li> </ul>

	<p>Altri utili riferimenti bibliografici sono:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Franses P.H. (2004), Breve Introduzione all'Econometria, Il Mulino.</li> <li>• Verbeek M. (2006), Econometria, Zanichelli.</li> <li>• Wooldridge J.M. (2009), Introductory Econometrics. A Modern Approach (4th Ed.), South-Western Cengage Learning.</li> </ul> <p>Per ogni argomento previsto nel programma viene reso disponibile agli studenti il materiale didattico di riferimento, costituito da appunti (slides proiettate in classe) con ulteriori riferimenti bibliografici e sitografici, test d'esame degli anni precedenti, problemi da svolgere durante il corso e loro soluzioni. Il materiale didattico è disponibile sul sito del docente.</p> <p>Per quanto riguarda il pacchetto statistico Stata, oltre allo online help, ai tutorials forniti con il programma, e allo Stata Reference Manual disponibile in biblioteca, si raccomanda:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Hamilton L.C. (2009), Statistics with Stata (Updated for Version 10), Brooks/Cole.</li> </ul> <p>Suggerimenti per ulteriori letture verranno forniti in classe</p>
Metodi utilizzati	Lezioni frontali, esercitazioni, e assegnazione di esercizi da svolgere a casa.
Modalità di accertamento dei risultati di apprendimento	Il voto finale si basa sui risultati ottenuti in due esoneri, che si tengono uno a metà e l'altro a fine corso. La determinazione del voto finale tiene anche conto dell'impegno nello svolgimento degli esercizi assegnati. Lo studente può ottenere punti addizionali presentando i risultati di un progetto empirico da concordare con il docente del corso.