

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 franco.peracchi@uniroma2.it martedì 9.30–11.30 (o su appuntamento) http://www.economia.uniroma2.it/nuovo/facolta/docenti/curriculum.asp?idProfessore=122
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"> 1. Introduzione. 2. Richiami di probabilità e statistica. 3. Regressione lineare con un singolo regressore. 4. Regressione con un singolo regressore: verifica di ipotesi e intervalli di confidenza. 5. Regressione lineare con regressori multipli. 6. Verifica di ipotesi e intervalli di confidenza nella regressione multipla. 7. Funzioni di regressione nonlineari. 8. Valutazione di studi basati sulla regressione multipla. 9. Regressione con dati panel. 10. Regressione con variabile dipendente binaria. 11. Regressione con variabili strumentali. 12. Esperimenti e quasi esperimenti. 13. Introduzione alla regressione con serie storiche. 14. Stima di effetti causali dinamici. 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"> • Stock J.H. e Watson M.W. (2012), Introduzione all'Econometria (terza edizione), Pearson Education Italia.

	<p>Altri utili riferimenti bibliografici sono:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Franses P.H. (2004), Breve Introduzione all'Econometria, Il Mulino. • Verbeek M. (2006), Econometria, Zanichelli. • Wooldridge J.M. (2009), Introductory Econometrics. A Modern Approach (4th Ed.), South-Western Cengage Learning. <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"> • Hamilton L.C. (2009), Statistics with Stata (Updated for Version 10), Brooks/Cole. <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 aggiuntivi presentando i risultati di un progetto empirico da concordare con il docente del corso.