

## SCHEDA DELL'INSEGNAMENTO DI ECONOMETRIA

<b>Corso di studio</b> FINANZA	<b>Titolo insegnamento in inglese</b> Econometrics	<b>Laurea/LM/LMcu</b> LM	<b>A.A.</b> 2017/2018
<b>Docente:</b> Antonio Acconcia Claudio Rossetti	<b>Tel.:</b> 081675096	<b>email:</b> <a href="mailto:antonio.acconcia@unina.it">antonio.acconcia@unina.it</a> <a href="mailto:claudio.rossetti@unina.it">claudio.rossetti@unina.it</a>	
<b>SSD</b> SECS-P/05	<b>CFU</b> 12	<b>Anno di corso</b> I	<b>Semestre</b> II

Insegnamenti propedeutici previsti: nessuno

### RISULTATI DI APPRENDIMENTO ATTESI

#### Conoscenza e capacità di comprensione

Lo studente deve dimostrare di conoscere gli strumenti di base per un'analisi econometrica relativa alla relazione tra due o più variabili, in particolare per ciò che attiene alla stima degli effetti causali e alla previsione circa i valori futuri di una variabile, quindi all'analisi inferenziale distinguendo tra popolazione e campione. Lo studente deve altresì dimostrare di conoscere i principali metodi alternativi utilizzabili per la stima delle relazioni di interesse.

#### Conoscenza e capacità di comprensione applicate

Lo studente dovrà essere in grado di formulare un progetto di analisi econometrica in tutte le sue fasi: scelta del modello per la verifica della relazione di interesse; scelta dei dati; discussione della validità interna ed esterna dell'analisi realizzata; utilizzo dei risultati per formulare giudizi o proposte relativamente al problema investigato.

#### Eventuali ulteriori risultati di apprendimento attesi, relativamente a:

- **Abilità comunicative:** Lo studente deve saper spiegare a persone non esperte, le nozioni di base dell'econometria e i risultati e le implicazioni di una analisi econometrica.
- **Capacità di apprendimento:** Lo studente deve essere in grado di accedere alle principali banche dati che sono disponibili sul web e di utilizzarle per sviluppare un'analisi empirica. Deve inoltre essere in grado di aggiornarsi leggendo i lavori empirici reperibili in letteratura.

### PROGRAMMA

Identificazione di un effetto causale: il concetto di esperimento e di trattamento, il contro-fattuale; la distorsione da selezione.  
Distribuzione condizionata e indipendenza in media; il concetto di regressione e l'analisi della varianza.  
Il metodo dei minimi quadrati con due variabili e dati cross section  
Il metodo dei minimi quadrati con variabili di controllo e dati cross section  
Proprietà algebriche dei minimi quadrati  
Proprietà statistiche dei minimi quadrati  
Il metodo delle variabili strumentali  
Teoremi asintotici: la legge dei grandi numeri e il teorema limite centrale  
Inferenza e test delle ipotesi  
Regressione con panel di dati  
Regressione con serie storiche  
Previsioni con serie storiche di dati

### CONTENTS

Identification of the causal effect: ideal experiment, treatment, selection bias.  
Conditional distribution and mean independence; regression analysis; the variance decomposition.  
The ordinary least square method for cross-sections with just two variables  
The ordinary least square method for cross-sections with controls  
Algebraic properties of ordinary least square estimate  
Statistical properties of ordinary least square estimator

SCHEDA DELL'INSEGNAMENTO DI ECONOMETRIA

**Corso di studio**  
FINANZA

**Titolo insegnamento in inglese**  
Econometrics

**Laurea/LM/LMcu**  
LM

**A.A.**  
2017/2018

**Docente:**  
Antonio Acconcia  
Claudio Rossetti

**Tel.:**  
081675096

**email:**  
[antonio.acconcia@unina.it](mailto:antonio.acconcia@unina.it)  
[claudio.rossetti@unina.it](mailto:claudio.rossetti@unina.it)

**SSD**  
SECS-P/05

**CFU**  
12

**Anno di corso**  
I

**Semestre**  
II

Insegnamenti propedeutici previsti: nessuno

The instrumental variable approach  
Law of large numbers and the central limit theorem  
Inference and testing economic hypotheses  
Regression with panel data  
Regression with time series  
Forecasting

**MATERIALE DIDATTICO** (max 4 righe, Arial 9)

Testi consigliati in alternativa  
Introduction to econometrics by Stock and Watson  
Introductory econometrics by Wooldridge

**FINALITA' E MODALITA' PER LA VERIFICA DI APPRENDIMENTO**

**a) Risultati di apprendimento che si intende verificare:**

**b) Modalità di esame:**

L'esame si articola in prova:  Scritta e orale       Solo scritta       Solo orale

Discussione di elaborato progettuale:

Altro (*specificare*): .....

**In caso di prova scritta, i quesiti sono\*:**       A risposta multipla       A risposta libera       Esercizi numerici  
(\* *possibili più risposte*)