# Econometria applicata

## Prof. Maria Grazia Zoia; Prof. Antonio Pesce.

***OBIETTIVO DEL CORSO E RISULTATI DI APPRENDIMENTO ATTESI***

Il corso è inteso a far conoscere, sotto il duplice profilo teorico e operativo, una gamma selezionata di tecniche econometriche finalizzate ad analizzare e modellizzare dati economici, operare previsioni, assumere decisioni in ambito economico e aziendale, con una attenzione mirata a problematiche in ambito aziendale, marketing, comunicazione, innovazione, finanza.

Le ricadute operative dei contenuti teorici del corso saranno illustrate tramite esempi applicativi sviluppati con i principali software econometrici.

Al termine del corso, gli studenti devono:

1. dimostrare conoscenze e capacità di comprensione dei modelli e delle tecniche dell’econometria delle serie storiche e delle serie finanziare; ciò al fine di essere in grado di modellizzare, interpretare e prevedere i fenomeni micro e macroeconomici;

2. essere in grado di applicare le conoscenze acquisite anche mediante l’utilizzo efficiente di software specializzati per l’analisi quantitativa dei fenomeni economici e finanziari;

3. saper formulare giudizi sulle ricadute, anche etiche e sociali, collegate alle applicazioni delle tecniche e modelli studiati durante il corso;

4. avere la capacità di comunicare i concetti appresi in modo chiaro e privo di ambiguità;

5. avere sviluppato capacità di apprendimento indispensabile per sviluppare una capacità autonoma di studio.

***PROGRAMMA DEL CORSO***

1. *Modellistica e previsione econometria*.

Modelli lineari in econometria: specificazione e stima.

Previsione: il ruolo dell’ipotesi di normalità.

2. *Estensioni del modello*.

Modelli multiequazionali. Causalità e interdipendenza. Modelli per variabili dicotomiche e policotomiche.

3. *Esemplificazioni di modelli econometrici generali e settoriali con applicazioni*.

4. *Elementi di econometria per la finanza*.

I fatti stilizzati dei dati finanziari. Oltre la normalità: distribuzioni leptocurtiche. Modellizzazione della volatilità: ARCH e GARCH. Modelli con memoria lunga.

5. *Elementi di econometria delle serie storiche*.

Modelli stocastici stazionari e non. La nozione d’integrazione. Il ruolo della cointegrazione.

6. *Principali software di uso corrente in econometria*.

***BIBLIOGRAFIA[[1]](#footnote-1)***

M. Marcellino, *Econometria applicata: un’introduzione,* Egea, 2013. [*Acquista da VP*](https://librerie.unicatt.it/scheda-libro/marcellino-massimiliano/econometria-applicata-unintroduzione-9788823821750-215141.html)

J.H. Stock-M. Watson, *Introduzione all’econometria,* Pearson, 2012. [*Acquista da VP*](https://librerie.unicatt.it/scheda-libro/james-h-stock-mark-w-watson/introduzione-alleconometria-ediz-mylab-9788891901248-243624.html)

P.H Franses-R. Paap, *Quantitative Models in Marketing Research*, Cambridge University Press, Cambridge, 2001.

M. Faliva-M. Zoia, *Introduzione all’econometria,* Giappichelli, Torino, 2003.

M. Zoia, *Topics in Time Series Econometrics,*EDUCatt, 2014. [*Acquista da VP*](https://librerie.unicatt.it/scheda-libro/m-grazia-zoia/topics-in-time-series-econometrics-9788867801480-687448.html)

G. Gallo-B. Pacini, *Metodi Quantitativi per I Mercati Finanziari,* Carocci, 2002. [*Acquista da VP*](https://librerie.unicatt.it/scheda-libro/barbara-pacini-giampiero-m-gallo/metodi-quantitativi-per-i-mercati-finanziari-9788843023066-221989.html)

Ulteriori indicazioni e materiale integrativo verranno forniti durante il corso.

***DIDATTICA DEL CORSO***

Lezioni frontali, seminari tematici.

***METODO E CRITERI DI VALUTAZIONE***

Al termine di ogni modulo è prevista una valutazione parziale consistente in un esame scritto basato su domande a risposta aperta su argomenti centrali del modulo svolti a lezione. È prevista, quando necessario, una integrazione orale a quanto risulta dall’elaborato scritto. La valutazione globale verrà attribuita al termine del corso come rislutante delle valutazioni parziali.

Chi non si avvale degli esami parziali, potrà sostenere l’esame completo relativo al programma svolto nei due moduli secondo le modalità sopra precisate – scritto, con eventuale integrazione orale – in un'unica sessione d’esame.

Tale modalità di esame non subirà variazione negli appelli delle varie sessioni e si applica a studenti frequentanti e non.

Ulteriori informazioni saranno rese disponibili sulla pagina personale dei docenti.

**AVVERTENZE E PREREQUISITI**

Conoscenze di base dell’inferenza statistica.

Nel caso in cui la situazione di emergenza relativa alla pandemia di Covid-19 non dovesse consentire lo svolgimento dell’attività didattica in presenza, sarà garantita l’erogazione dell’insegnamento in distance learning con modalità che saranno comunicate in tempo utile agli studenti.

*Orario e luogo di ricevimento*

I Professori ricevono gli studenti presso il loro studio in orario che verrà reso noto all’inizio delle lezioni, oppure previo appuntamento via email.

Nel caso in cui la situazione di emergenza relativa alla pandemia di Covid-19 non dovesse consentire lo svolgimento dell’attività didattica in presenza, sarà garantita l’erogazione dell’insegnamento in distance learning con modalità che saranno comunicate in tempo utile agli studenti.

1. I testi indicati nella bibliografia sono acquistabili presso le librerie di Ateneo; è possibile acquistarli anche presso altri rivenditori. [↑](#footnote-ref-1)