



Insegnamento: ECONOMETRIA			
Codifica: 50902939		SSD (settore scientifico disciplinare): SECS-P/05	
Docente Responsabile: Paola Cardamone			
Crediti Formativi (CFU): 5			
Ore di lezione	30 (+ 10 di didattica integrativa)	Ore riservate allo studio individuale	85
Lingua d'insegnamento: Italiano 			
Anno di corso: terzo			
Propedeuticità: Microeconomia, Macroeconomia, Statistica			
Organizzazione della Didattica: Lezioni ed esercitazioni			
Modalità di frequenza: obbligatoria			
Modalità di erogazione: tradizionale			
Metodi di valutazione: Struttura della prova scritta: 1 domanda teorica e 1 esercizio Orale: facoltativo			
Programma/contenuti La natura dell'analisi di regressione. Origine storica del termine "regressione". Natura dei dati (dati sezionali, dati temporali, dati pooled, dati panel). La regressione lineare semplice. Minimi quadrati ordinari (OLS). Proprietà algebriche degli stimatori OLS. Il coefficiente di determinazione. Il significato del termine "lineare". Forme funzionali (modelli log-lineari, log-lin, lin-log, modelli reciproci). Le assunzioni del modello di regressione lineare semplice. Proprietà statistiche degli stimatori OLS. Il teorema di Gauss-Markov. Regressione attraverso l'origine. Unità di misura delle variabili. Coefficienti Beta. La regressione lineare multipla. Le proprietà algebriche degli stimatori OLS in un modello di regressione multipla. Il coefficiente di determinazione corretto. L'utilizzo del coefficiente di determinazione per confrontare due modelli. Le assunzioni del modello di regressione lineare multipla e proprietà statistiche degli stimatori OLS. Distorsione dovuta all'omissione di variabili rilevanti. Inclusione di variabili irrilevanti. Ipotesi di normalità dei residui. Test delle ipotesi. Ipotesi di significatività dei coefficienti. Intervalli di confidenza dei beta. Intervalli di confidenza della varianza del termine d'errore. Test di significatività congiunta dei coefficienti. Un'importante relazione tra il coefficiente di determinazione e la statistica F-Fisher. Test sul contributo marginale di un regressore o di un set di regressori. Minimi quadrati ristretti: l'approccio della t-student e l'approccio della F-Fisher. L'uso delle variabili dicotomiche.			
Date di inizio e termine e il calendario delle attività didattiche: 18/05/09 – 04/07/09 per il calendario delle attività didattiche: www.economia.unical.it			

**Il calendario delle prove di esame**

Le date degli appelli d'esame vengono fissate e rese pubbliche sul sistema UNIWEX (<http://didattica.unical.it>) in accordo a quanto previsto dal Calendario Accademico 2008-2009 della Facoltà di Economia che prevede le seguenti sessioni d'esame:

I sessione (17/11/2008-06/12/2008) – un appello;

II sessione (09/02/2009-07/03/2009) – due appelli;

III sessione (27/04/2009-16/05/2009) – un appello;

IV sessione (06/07/2009-31/07/2009) – due appelli;

V sessione (31/08/2009-26/09/2009) – un appello.

Bibliografia

Wooldridge J.M., Introductory Econometrics. A Modern Approach, 3rd Edition,
Thomson-South-Western

Gujarati D.N., 2003, Basic Econometrics, McGraw-Hill, New York.