



UNIVERSITÀ
DEGLI STUDI DI MILANO-BICOCCA

SYLLABUS DEL CORSO

Microeconometria

1819-1-F8204B001-F8204B002M

Obiettivi formativi

Il corso si propone di fornire allo studente strumenti avanzati, di natura teorica e applicata, riguardanti i modelli per dati panel, i modelli per variabili dipendenti qualitative, “censurate” o “troncate”, i modelli per dati count e i modelli di durata.

Al termine del corso, lo studente sarà in grado di applicare quanto appreso a casi reali, avendo sviluppato un’adeguata capacità critica per quanto riguarda la scelta degli strumenti e l’interpretazione dei risultati.

Contenuti sintetici

- Introduzione, motivazione e definizioni
- Modelli per serie storiche pooled
- Modelli per dati longitudinali
- Dati panel e modelli two-way
- Dati panel e modelli dinamici
- Modelli per variabili dipendenti qualitative: scelte binarie
- Modelli per variabili dipendenti qualitative: scelte multiple
- Modelli per variabili limitate: censura e troncamento

- Modelli per dati count
- Modelli per dati di durata

Programma esteso

- Richiami sugli stimatori di base (OLS, GLS, IV)
- Eteroschedasticità cross-sezionale e autocorrelazione
- Effetti fissi (stimatore OLS con variabili dummy, trasformazione within)
- Effetti casuali, non correlati con i regressori (stimatore GLS, trasformazione between)
- Effetti casuali, correlati con i regressori (stimatore IV)
- Modelli panel two-way: effetti fissi e casuali
- Modelli panel dinamici: differenze prime e stimatori IV e GMM
- Modelli per variabili dipendenti qualitative: scelte binarie (Logit e Probit)
- Modelli per variabili dipendenti qualitative: scelte multiple (Multinomial e Conditional Logit, Nested Logit)
- Modelli per variabili limitate: censura e troncamento (Tobit)
- Modelli per dati count (Poisson e Binomiale negativa)
- Modelli di durata

Prerequisiti

Nessuno. Tuttavia sono date per acquisite le nozioni di base di econometria, microeconomia e macroeconomia.

Metodi didattici

Lezioni frontali (in aula e in laboratorio informatico).

Modalità di verifica dell'apprendimento

L'esame consiste in una prova scritta e in una prova orale (interpretazione dell'output di regressione).

Testi di riferimento

- W. Greene, Econometric Analysis, Prentice Hall International, 4^a edizione, 2002
- G.S. Maddala, Limited-Dependent and Qualitative Variables in Econometrics, Cambridge University Press, 1983
- M. Manera, M. Galeotti, Microeconometria, Metodi e Applicazioni, Carocci, 2005
- J.M. Wooldridge, Econometric Analysis of Cross Sections and Panel Data, The MIT Press, 2002

Periodo di erogazione dell'insegnamento

Secondo semestre.

Lingua di insegnamento

Italiano.
