



UNIVERSITÀ
DEGLI STUDI DI MILANO-BICOCCA

SYLLABUS DEL CORSO

Econometria

1920-2-E4101B017

Obiettivi formativi

L'obiettivo dell'econometria è costituito dall'analisi quantitativa dei fenomeni economici.

Tale analisi si avvale di modelli fondati sulla teoria economica, stimati con appropriate metodologie statistiche e applicati a serie di dati economici.

Il corso si propone di fornire agli studenti: 1) gli strumenti statistico-econometrici necessari per la specificazione, la stima e la selezione di modelli che descrivono le relazioni economiche tramite serie storiche e dati longitudinali; 2) le conoscenze di base del software econometrico Stata necessarie per realizzare applicazioni a problemi e dati reali.

Contenuti sintetici

1. Introduzione e definizioni
2. Il modello di regressione lineare classico
3. Il modello lineare generalizzato
4. Test diagnostici
5. Modelli a equazioni simultanee

Programma esteso

- a. Economia e statistica nei modelli econometrici
- b. Richiami sul modello di regressione lineare classico: lo stimatore OLS
- c. Eteroschedasticità e autocorrelazione: lo stimatore GLS
- d. Test diagnostici
- e. Il modello lineare con informazioni estranee al campione: lo stimatore RLS
- f. Il modello lineare con regressori stocastici: lo stimatore IV
- g. Il problema della specificazione dei modelli
- h. Modelli a equazioni simultanee: identificazione e stima

Prerequisiti

Questa attività formativa non prevede alcuna propedeuticità. Tuttavia risulta necessaria una conoscenza di base di statistica e microeconomia.

Metodi didattici

L'attività formativa è svolta attraverso lezioni teoriche e in laboratorio.

Modalità di verifica dell'apprendimento

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

Testi di riferimento

- A. Gardini, G. Cavaliere, M. Costa, L. Fanelli, P. Paruolo, *Econometria*, Franco Angeli, 2000
- J. Johnston, *Econometrica*, Franco Angeli, 3a edizione, 1993
- G. Koop, *Logica Statistica dei Dati Economici*, Utet, 2001
- M. Manera, *Introduzione all'Econometria*, Carocci, di prossima pubblicazione

- F. Peracchi, Econometria, McGraw Hill, 1995
- J.H..Stock, M.W. Watson, Introduzione all'Econometria, Pearson-Prentice Hall, 2005

Per alcune parti del corso verrà indicato materiale aggiuntivo.

Periodo di erogazione dell'insegnamento

Secondo semestre.

Lingua di insegnamento

Italiano.
