UNIVERSITÀ
DEGLI STUDI DI MILANO-BICOCCA

COURSE SYLLABUS

Econometrics

2122-1-F5602M002-F5602M004M

Obiettivi formativi

Il corso fornisce le competenze essenziali per fare ricerca empirica in microeconomia e macroeconomia.

Contenuti sintetici

Gli studenti vengono introdotti ai temi principali relativi al lavoro applicato di un economista.

Programma esteso

- The simple regression model
- Multiple regression analysis: estimation, inference, asymptotics
- Multiple regression analysis: further issues
- Multiple regression analysis with qualitative information
- Heteroskedasticity
- More on specification and data problems
- Basic regression analysis with time series data
- Further issues in using OLS with time series data
- Serial correlation and heteroskedasticity in time series regressions
- Models based on Panel Data
- IV estimation and 2SLS
- Simultaneous equations models
- Models with limited dependent variables
- Advanced Time Series Topics

Prerequisiti

Statistica, matematica.

Metodi didattici

Particolare enfasi viene posta sull'utilizzo di pacchetti econometrici per l'analisi dei dati. Sessioni applicate al computer sono un elemento essenziale del corso.

Modalità di verifica dell'apprendimento

Per i frequentanti la valutazione si basa su un esame scritto individuale e sulla presentazione di un progetto econometrico di gruppo.

Per i non frequentanti la valutazione si basa su un esame orale individuale e sulla presentazione di un progetto econometrico individuale.

Testi di riferimento

"Introductory econometrics: a modern approach", by J.M. Wooldridge, Thompson South Western, Belmond, 5th ed.

Periodo di erogazione dell’insegnamento

Secondo semestre.

Lingua di insegnamento

Inglese