UNIVERSITÀ
DEGLI STUDI DI MILANO-BICOCCA

COURSE SYLLABUS

Econometrics

2324-2-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 finale, unico, consiste in una parte scritta e in una parte orale.

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.

Sustainable Development Goals