



UNIVERSITÀ  
DEGLI STUDI DI MILANO-BICOCCA

## COURSE SYLLABUS

### Econometrics

2324-1-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, Belmont, 5th ed.

## **Periodo di erogazione dell'insegnamento**

Secondo semestre.

## **Lingua di insegnamento**

Inglese

## **Sustainable Development Goals**

---