



UNIVERSITÀ
DEGLI STUDI DI MILANO-BICOCCA

COURSE SYLLABUS

Econometrics

2425-2-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

Tutte le lezioni sono svolte in presenza in modalità erogativa. In particolare, 9 lezioni da 2 ore svolte in modalità erogativa in presenza e 8 lezioni da 3 ore svolte in modalità erogativa in presenza. Alcune lezioni prevedono che gli studenti utilizzino il proprio pc e il software econometrico/statistico Stata.

Modalità di verifica dell'apprendimento

L'esame finale, unico, consiste in una prova scritta, con domande aperte, problemi ed esercizi, a libri chiusi. L'esame valuta le competenze teoriche (tecniche econometriche trattate a lezione) ed empiriche (interpretazione critica dell'output di modelli econometrici con cui è possibile tradurre i principali problemi di interesse per l'economista applicato) acquisite durante il corso.

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

ISTRUZIONE DI QUALITÀ
