

## SYLLABUS DEL CORSO

### Econometrics

2526-1-F5603M003-F5603M003-2

---

#### Obiettivi formativi

Il corso fornisce le competenze essenziali per fare analisi 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. Lezioni svolte in modalità erogativa nella parte iniziale e in modalità interattiva nella parte successiva. Tutte le attività sono svolte in presenza.

## **Modalità di verifica dell'apprendimento**

La valutazione degli studenti frequentanti si basa su una presentazione in classe di un progetto empirico (50% del voto finale) e su un esame scritto (50% del voto finale). L'esame scritto si articola in due parti. Parte A: 32 domande a risposta chiusa volte a valutare la conoscenza da parte dello studente dei concetti trattati nel corso. Parte B: 16 domande a risposta chiusa basate su applicazioni con Stata su dati reali, volte a valutare la capacità dello studente di applicare i concetti del corso. Ogni risposta corretta (errata) vale 0,75 (-0,75) punti. La valutazione del progetto empirico, volto a valutare la capacità dello studente di applicare i concetti appresi durante il corso, si baserà sui seguenti quattro criteri: originalità, rilevanza, qualità, competenza.

La valutazione per gli studenti non frequentanti si basa su un esame orale. L'esame orale consiste in (1) una serie di domande aperte che coprono l'intero programma (50% del voto finale) e (2) la discussione di un progetto empirico presentato dallo studente (50% del voto finale). L'esame orale ha lo scopo di valutare la conoscenza da parte dello studente dei concetti del corso e la sua capacità di applicarli. La valutazione del progetto empirico, volto a valutare la capacità dello studente di applicare i concetti appresi durante il corso, si baserà sui seguenti quattro criteri: originalità, rilevanza, qualità, competenza.

## **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

---