

# Econometria – Cod. 6089

## Classe 10 – A. A. 2010/11

**Docente:** Tommaso Nannicini

**Tutor:** Gabriele Deana

**Libro di testo:**

Dispense dei docenti (Maria Luisa Mancusi, Tommaso Nannicini)

**Altri testi di riferimento (facoltativi):**

- Verbeek M. (2004), *A Guide to Modern Econometrics*, Wiley, 2<sup>nd</sup> edition [V]
- Wooldridge J.M. (2006), *Introductory Econometrics*, Thomson, 3<sup>rd</sup> edition [W]

**Materiale aggiuntivo:**

Gli studenti potranno scaricare il materiale didattico (esercizi assegnati in classe, esercitazioni in aula informatica, etc.) dal sito [www.tommasonannicini.eu](http://www.tommasonannicini.eu) o dalla piattaforma E-Learning sul sito dell'università.

**Orario di ricevimento:**

- Martedì 14:30-16:30 (via Rontgen 1, 5° piano, D1-16) oppure su appuntamento (e-mail: [tommaso.nannicini@unibocconi.it](mailto:tommaso.nannicini@unibocconi.it)).

**Modalità di esame:**

L'esame è solo scritto e può essere sostenuto in un'unica prova generale, della durata di 90 minuti, oppure in due prove parziali, della durata di 45 minuti ciascuna. In quest'ultimo caso, l'esame si considera superato solo se entrambe le prove hanno dato esito sufficiente. Con la firma del compito lo studente s'impegna ad accettare il voto sufficiente che gli verrà attribuito.

**Programma del corso:**

- 1) Il modello di regressione lineare
  - Specificazione, ipotesi, interpretazione
  - Stima dei parametri e proprietà degli stimatori
  - Analisi della varianza,  $R^2$
  - Stima per intervallo
  - Test di ipotesi: i test t ed F
  - Collinearità

- Variabili omesse e variabili irrilevanti
- Test della stabilità dei parametri
- Uso di variabili dummy
- Applicazioni empiriche

*Riferimenti bibliografici*

Dispense dei docenti

V: capitoli 2, 3

W: capitoli 2-7, 9

2) Il modello di regressione lineare generalizzato

- Specificazione, ipotesi, interpretazione
- Stima dei parametri
- Proprietà degli stimatori
- Test di ipotesi
- Test per omoschedasticità e non-autocorrelazione
- Applicazioni empiriche

*Riferimenti bibliografici*

Dispense dei docenti

V: capitolo 4

W: capitoli 8, 12

3) Il modello di regressione lineare con regressori endogeni

- Specificazione, ipotesi, interpretazione
- Correlazione tra regressori ed errore
- Stimatori con variabili strumentali
- Test di sovraidentificazione
- Applicazioni empiriche

*Riferimenti bibliografici*

Dispense dei docenti

V: capitolo 5

W: capitolo 15

4) Modelli per dati qualitativi

- Cenni di stima di massima verosimiglianza
- Variabile dipendente binaria
- Modelli LOGIT e PROBIT: specificazione e stima
- Applicazioni empiriche

*Riferimenti bibliografici*

Dispense dei docenti

V: paragrafo 7.1

W: paragrafo 17.1

5) Modelli per dati panel

- Tipologia
- Modelli con effetti fissi
- Modelli con effetti stocastici
- Test di Hausman
- Applicazioni empiriche

*Riferimenti bibliografici*

Dispense dei docenti

V: paragrafi 10.1-10.3

W: capitolo 14