

Introduzione all'Econometria

Paolo Santucci de Magistris

March, 2011

- Modello di regressione multipla;

1. Ipotesi;
2. Il metodo dei minimi quadrati;
3. Test t;
4. Test F;
5. Durbin-Watson;
6. Test di Stabilità;
7. Omoschedasticità, test di White;
8. Autocorrelazione seriale nei residui;

- Variabili Strumentali;

1. Problema di endogenità;
2. Stimatore a due stadi

- Metodo Generalizzato dei Momenti;

1. Metodo dei momenti;
2. La matrice dei pesi e inferenza;

- Modelli per le serie storiche

1. Serie stazionarie ed integrate;
2. Modelli ARMA;
3. Test di radice unitaria;
4. VAR;
5. Cointegrazione;

Software: GRETL

Bibliografia:

- W.Greene, Econometric Analysis, 5th Edition
- J. Wooldridge, Introductory Econometrics: A Modern Approach