

## Econometria Applicata II Modulo – Primo Semestre A.A. 2014/2015

**Samantha Leorato**

Email: [samantha.leorato@uniroma2.it](mailto:samantha.leorato@uniroma2.it)

**Ricevimento durante il I semestre:**

Mercoledì 16-17.30 (chiedere con. per email)

**Ricevimento fuori dal corso:**

Su appuntamento

### **Durata del corso**

Il corso dura 6 settimane, da lunedì 22 settembre a mercoledì 29 ottobre.

### **Lezioni**

Lunedì-Martedì-Mercoledì: 14.00-16.00, aula da definire.

### **Propedeuticità**

E' richiesta la conoscenza dei concetti principali dell'algebra lineare, come: vettori e matrici, matrice trasposta, matrice inversa, determinante, prodotto tra matrici, autovalori e autovettori, traccia di una matrice, ecc.. Una dispensa di algebra lineare che racchiude le nozioni fondamentali è scaricabile dalla pagina del materiale didattico ([algebra\\_lineare.pdf](#)).

Un altro prerequisito è la conoscenza dei concetti principali dell'inferenza statistica.

### **Regolamento d'Esame**

L'esame finale consiste in una prova scritta della durata di circa 1 ora e mezzo, più un confronto orale per la verifica e la convalida del voto della prova scritta. **NON ci sarà preappello.**

La prova scritta è composta da domande a risposta multipla, esercizi e dimostrazioni. E' possibile portare calcolatrici. L'ultima data utile per la verbalizzazione è l'ultimo appello della sessione autunnale, dopodiché l'esame non è più valido.

### **Problem set**

Durante il corso saranno assegnati 3 problem set (PS), che dovranno essere consegnati in formato elettronico o cartaceo in data comunicata dal docente. Lo svolgimento e il completamento di entrambi i PS da diritto a 3 punti di bonus. I **punti bonus** saranno **validi fino alla fine della sessione invernale**.

Ciascun PS sarà costituito da esercizi simili a quelli proposti negli esami. Potrà inoltre comprendere un esercizio da svolgere mediante l'utilizzo di un pacchetto statistico.

Dopo la consegna degli esercizi svolti, saranno disponibili on-line le soluzioni.

### **Libro di testo**

Dispense del corso

Marno Verbeek, Econometria, ed. Zanichelli. Letture aggiuntive (on-line sul sito del docente).

### **Web Page**

Il materiale del corso (syllabus, slides, letture aggiuntive...) sarà disponibile nel nuovo portale docente (Delphi).

## **SCHEMA DEL CORSO**

1. Modello di regressione lineare e metodo dei minimi quadrati con applicazioni.
2. Eteroschedasticità e autocorrelazione. Metodo dei MQ generalizzati.
3. Metodi basati sulla verosimiglianza.
4. Variabili strumentali.
5. Modelli lineari per dati panel.
6. Modelli di regressione per variabili categoriche.
7. Regressione quantile.