




Insegnamento: ECONOMETRIA 2			
Codifica: 50902722		SSD (settore scientifico disciplinare): SECS-P/02	
Docente Responsabile: Francesco Aiello			
Crediti Formativi (CFU): 5			
Ore di lezione	30	Ore riservate allo studio individuale	95
Il corso/i di studio, per i quali lo stesso costituisce un'attività di base o caratterizzante: Corso di Laurea Specialistica in Economia Applicata			
Lingua d'insegnamento: Italiano 			
Anno di corso: primo			
Propedeuticità: Econometria			
Organizzazione della Didattica: Lezioni			
Modalità di frequenza: Obbligatoria			
Modalità di erogazione: Tradizionale			
Metodi di valutazione: Prova scritta: una domanda teorica e un esercizio. Prova orale facoltativa.			
Programma/contenuti			
Rimozione delle assunzioni del modello classico di regressione lineare Autocorrelazione. Eteroschedasticità. Multicollinearità			
Regressione con variabili ritardate. Modelli con variabile dipendente ritardata. Modelli a ritardi distribuiti Autocorrelazione e non corretta specificazione. Uso del trend nella regressione. Specificazione dinamica di un modello uniequazionale. Modello a correzione dell'errore.			
Regressione con dati panel. I dati panel. Dati panel con 2 periodi. La regressione con effetti fissi. La regressione con effetti temporali. La regressione con effetti random.			
Regressione con variabile dipendente binaria. Variabili dipendenti binarie e modello lineare di probabilità. Regressioni probit e logit. Stima e inferenza nei modelli logit e probit.			
Regressione con variabili strumentali. Lo stimatore IV con un singolo repressore e un singolo strumento. Il modello generale di regressione IV. Verifica della validità degli strumenti. Dove trovare gli strumenti validi.			
Date di inizio e termine e il calendario delle attività didattiche: 18/05/08 – 04/07/09 per il calendario delle attività didattiche: www.economia.unical.it			
Il calendario delle prove di esame Le date degli appelli d'esame vengono fissate e rese pubbliche sul sistema UNIWEX (http://didattica.unical.it) in accordo a quanto previsto dal Calendario Accademico 2008-			



2009 della Facoltà di Economia che prevede le seguenti sessioni d'esame:

I sessione (17/11/2008-06/12/2008) – un appello;

II sessione (09/02/2009-07/03/2009) – due appelli;

III sessione (27/04/2009-16/05/2009) – un appello;

IV sessione (06/07/2009-31/07/2009) – due appelli;

V sessione (31/08/2009-26/09/2009) – un appello.

Bibliografia

Wooldridge J.M., Introductory Econometrics. A Modern Approach, 3rd Edition, Thomson-South-Western

Gujarati D.N., 2003, Basic Econometrics, McGraw-Hill, New York

Johnston J., 1994, Econometrica, FrancoAngeli, Milano

Stock, J.H. e Watson M.W., 2005, Introduzione all'econometria. Pearson Education Italia S.r.l., Milano.