

Programma seconda prova intermedia (riferito alla 3° edizione dello Stock and Watson: Introduzione all'Econometria)

Capitolo 8: tutto il capitolo esclusa l'appendice

Capitolo 9: tutto il capitolo

Capitolo 17:

Solo 17.1 (Assunzioni generalizzate minimi quadrati) e 17.5 (Minimi quadrati ponderati).

Esclusi 17.2, 17.3 e 17.4.

Capitolo 18:

Non richiesta ma consigliata la lettura del paragrafo 18.1 e 18.4 (solo la parte su Rappresentazione matriciale delle statistiche di regressione).

Esclusi 18.2, 18.3, 18.5, 18.6 e 18.7

Capitolo 10:

Tutto esclusa appendice

Capitolo 11:

Tutto. In appendice fare:

- 1) Stimatore ML per n variabili causali bernoulliane i.i.d
- 2) Stimatore ML per modello probit
- 3) Stimatore ML per modello logit

Capitolo 12:

Tutto. Esclusa Appendice

Capitolo 14: Tutto.

In Appendice solo 14.2: stazionarietà modello AR(1)

Nota: Per ciascun capitolo, sono inoltre richiesti gli esercizi del libro di testo mostrati in classe.