

**Econometria**  
**(Luca De Angelis)**  
**a.a. 2018-2019**

**Domande di preparazione alla prova scritta di esame:**

1. Il candidato definisca le proprietà del modello lineare generalizzato, il modello lineare ad errori eteroschedastici ed il modello lineare classico.
2. Il candidato derivi lo stimatore OLS.
3. Il candidato illustri e dimostri le proprietà dello stimatore OLS nel modello lineare generalizzato.
4. Il candidato illustri e dimostri le proprietà dello stimatore OLS nel modello lineare classico.
5. Il candidato derivi lo stimatore GLS.
6. Il candidato illustri e dimostri le proprietà dello stimatore GLS.
7. Il candidato enunci i teoremi di Aitken e Gauss-Markov.
8. Il candidato derivi lo stimatore dei minimi quadrati vincolati (RLS).
9. Il candidato dimostri la consistenza dello stimatore OLS, elencando le ipotesi usate.
10. Il candidato dimostri la normalità asintotica dello stimatore OLS, elencando le ipotesi usate.
11. Il candidato discuta il problema della scelta dei regressori ed in particolare il caso di modello sottoparametrizzato.
12. Il candidato discuta il problema della scelta dei regressori ed in particolare il caso di modello sovrapparametrizzato.
13. Il candidato discuta lo stimatore delle variabili strumentali (IV).