



UNIVERSITA' DEGLI STUDI di MESSINA

Dipartimento di Economia

Corso di laurea Magistrale in Scienze Economiche e Finanziarie – LM56

Scuola di Dottorato in Economics, Management and Statistics

Corso di Laurea In Economia, Banca e Finanza – L33

AVVISO DI SEMINARIO

Mercoledì, 9 Maggio 2018 ore 11,00 - Aula 2

Il prof. Giorgio Calzolari

Docente di Econometria presso le Università di Firenze e di Konstanz

terrà un seminario di approfondimento didattico dal titolo:

“Stimatori Robusti con Matrici Sandwich”

abstract:

Consistency and asymptotic efficiency of maximum likelihood estimator require, besides regularity assumptions, correct specification of the probability (density) of the underlying error process. When the likelihood is derived from a probability (density) not coinciding with the data generating process, the estimation method should be more properly defined "quasi maximum likelihood" or "pseudo maximum likelihood". In this case, the well known identity on Fisher's information matrix (Hessian and Outer Product) is not valid anymore. The traditional (asymptotic) variance-covariance matrix of the estimated parameters must be replaced by a "robust" matrix, whose expression involves both the Hessian and the Outer Product matrix.

Dottorandi e Studenti (in particolare dei Corsi di Laurea L-33 e LM-56 e dei Corsi di Master) sono invitati a partecipare.