



Kursplan

Ekonomihögskolan

Institutionen för nationalekonomi och statistik

1NA011 Ekonometri, 7,5 högskolepoäng

1NA011 Econometrics, 7.5 credits

Huvudområde

Nationalekonomi

Ämnesgrupp

Nationalekonomi

Nivå

Grundnivå

Fördjupning

G1F

Fastställande

Fastställd av Ekonomihögskolan 2013-10-15

Kursplanen gäller från och med höstterminen 2014

Förkunskaper

Nationalekonomi 30 hp, inklusive kurspoäng i grundläggande mikro- och makroekonomi, samt statistik 15 hp eller kurspoäng inom tidsserie- och regressionsanalys, och Engelska B, eller motsvarande

Mål

Efter avslutad kurs förväntas studenten kunna:

- formulera en hypotesmodell utifrån ekonomisk teori och utifrån denna specificera en testbar ekonometrisk modell
- förklara och redogöra för regressionsmodeller (enkla och multipla), deras egenskaper och inferens
- identifiera, förklara och lösa problem såsom heteroskedasticitet, autokorrelation och multikollinearitet
- förklara och redogöra för tidsseriemodeller såsom ARIMA och ARCH/GARCH
- förklara och identifiera Granger-kausaltet, (icke-)stationaritet och kointegration
- tillämpa regressionsmodeller för att skatta och analysera ekonomiska samband
- förklara möjligheter och begränsningar kopplade till olika data vid användandet av regressionsanalys
- förklara och redogöra för intuitionen för de vanligaste förekommande statistiska metoderna för att isolera kausala effekter

- tolka och såväl skriftligt som muntligt rapportera resultat från en regressionsanalys på ett vetenskapligt och populärvetenskapligt sätt
- använda statistiska mjukvaruprogram för att genomföra databearbetning och estimering

Innehåll

Syftet med kursen är att gå igenom grundläggande regressionsanalys som frekvent används inom nationalekonomi.

Kursen omfattar följande moment:

- minsta kvadratmetoden
- modellspecifikation och diagnostiska test
- dynamiska ekonometriska modeller
- kausalitet och instrumentvariabelmetoden
- identifikation, skattning, diagnostik och prognosskattning av ARIMA-modeller

Undervisningsformer

Föreläsningar, laborationer samt obligatoriska seminarier.

Examination

Kursen bedöms med betygen Underkänd, Godkänd eller Väl godkänd.

Bedömningen av de studerandes prestationer sker i form av laboration, muntlig och skriftlig presentation samt skriftlig salstentamen.

För kursen som helhet ges något av betygen: väl godkänd, godkänd, underkänd samt A-F enligt ECTS betygsskala.

För betyget godkänd ska målen vara uppnådda; betyget avgörs av hur väl studenten har uppfyllt målen. För sammanvägning av betyg till kursbetyg hänvisas till dokumentet ”Principer för betygsrapportering dnr ELNU 2011/160”.

För studerande, som ej blivit godkända vid ordinarie tentamenstillfälle, erbjuds möjlighet till omtentamen i regel 5-8 veckor efter ordinarie provtillfälle. Vid skriftlig tentamen ges totalt minst fem tillfällen per delkurs att tentera för den kursplan till vilken studenten antagits. Vanligtvis ges 3 tillfällen per läsår.

Kursvärdering

En skriftlig kursvärdering genomförs och sammanställs i en rapport, vilken arkiveras vid fakulteten. Resultatet och eventuellt vidtagna åtgärder kommuniceras av kursansvarig och presenteras för studenterna vid nästa kurstillfälle eller på annat sätt som kursansvarig finner lämpligt. Andra typer av kursutvärderingar, exempelvis löpande under kursens gång eller samtal med studenterna förekommer och uppmuntras i syfte att säkerställa kontinuerlig kvalitetsutveckling.

Kurslitteratur och övriga läromedel

Obligatorisk litteratur:

Gujarati, D.N. *Basic Econometrics*. McGraw- Hill. Senaste upplagan. 900 sidor.

Vetenskapliga artiklar och statistik som tillhandahålls av läraren. Ca. 100 sidor.