



Kursplan

Ekonomihögskolan

Institutionen för nationalekonomi och statistik

1NA071 Ekonometri, 7,5 högskolepoäng

1NA071 Econometrics, 7.5 credits

Huvudområde

Nationalekonomi

Ämnesgrupp

Nationalekonomi

Nivå

Grundnivå

Fördjupning

G1F

Fastställande

Fastställd 2014-10-15

Senast reviderad 2022-03-14 av Ekonomihögskolan. Revidering av förkunskapskrav och uppdatering av standardtexter.

Kursplanen gäller från och med höstterminen 2022

Förkunskaper

Nationalekonomi 30 hp, inklusive kurspoäng i grundläggande mikro- och makroekonomi, samt statistik 15 hp eller kurspoäng inom tidsserie- och regressionsanalys, och Engelska 6, eller motsvarande.

alternativ,

För student som läser kursen som del av Civilekonomprogrammet ska ha:

Minst 60 hp inom Företagsekonomi samt Rättsvetenskap.

samt

- Makroekonomi 15 hp,
- Mikroekonomi 15hp,
- Ekonomisk Statistik I 7,5 hp,
- Ekonomisk statistik II 7,5 hp,
- Engelska 6, eller motsvarande.

Mål

Efter avslutad kurs förväntas studenten kunna:

- 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 AR och ARCH modeller
- förklara och identifiera Granger-kausalitet, (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 vanligast förekommande statistiska metoderna för att isolera kausala effekter
- tolka och såväl skriftligt som muntligt rapportera resultat från en regressionsanalys
- 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

Undervisningen består av föreläsningar, laborationer och handledning.

Examination

Kursen bedöms med betygen A, B, C, D, E, Fx eller F.

Kursen examineras genom en skriftlig salstentamen (5,5 hp), en laboration (1 hp) och en skriftlig inlämningsuppgift (1 hp).

Betyget A utgör det högsta betygssteget, resterande betyg följer i fallande ordning där betyget E utgör det lägsta betygssteget för att vara godkänd. Betyget F innebär att studentens prestationer bedömts som underkända. Betygskriterier för A-F-skalan kommuniceras skriftligt till studenten senast i samband med kursstart, liksom hur sammanvägning och viktning av betyg på enskilda examinerande moment till slutligt kursbetyg sker. Grunden för betyg avgörs av studentens målpuppfyllelse.

Förnyad examination ges i enlighet med Lokala regler för kurs och examination på grundnivå och avancerad nivå vid Linnéuniversitetet. Examinator kan undantagsvis bestämma att en student som ligger nära gränsen för godkänt betyg får utföra kompletterande uppgifter för att nå upp till betyget godkänd.

Om universitetet beslutat att en student har rätt till särskilt pedagogiskt stöd på grund av funktionsnedsättning, har examinator rätt att ge ett anpassat prov eller att studenten genomför provet på ett alternativt sätt.

Kursvärdering

Under kursens genomförande eller i nära anslutning till kursen genomförs kursvärdering. Resultat och analys av genomförd kursvärdering ska skyndsamt återkopplas till de studenter som genomfört kursen. Studenter som deltar vid nästa kurstillfälle erhåller återkoppling vid kursstart. Kursvärdering genomförs anonymt.

Överlappning

Kursen kan inte ingå i examen med annan kurs, vars innehåll helt eller delvis överensstämmer med innehållet: 1NA005:2, 2NA001, 2FE045:2, 1NA004:2, 1NA011, och 1NA016:2 med 7,5 hp vardera.

Övrigt

I de fall undervisningsspråket i kursen är engelska kommer även examinationer ges på engelska.

Kurslitteratur och övriga läromedel

Obligatorisk litteratur:

Wooldridge, J. *Introductory Econometrics*. Cengage. Senaste upplaga. Cirka 830 sidor.

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