



Kursplan

Ekonomihögskolan

Institutionen för nationalekonomi och statistik

4NA061 Avancerad Ekonometri, 7,5 högskolepoäng

4NA061 Advanced Econometrics, 7.5 credits

Huvudområde

Nationalekonomi

Ämnesgrupp

Nationalekonomi

Nivå

Avancerad nivå

Fördjupning

A1N

Fastställande

Fastställd 2018-12-13

Senast reviderad 2023-10-09 av Ekonomihögskolan. Revidering av förkunskapskrav, uppdatering av standardtexter, förtydligande av mål, innehåll och examination.

Kursplanen gäller från och med höstterminen 2024

Förkunskaper

Grundläggande behörighet för studier på avancerad nivå och 30 högskolepoäng inom nationalekonomi, statistik, finans, matematik eller motsvarande. Engelska 6, eller motsvarande.

Mål

Efter avslutad kurs förväntas studenten kunna:

- härleda och förklara den linjära regressionsmodellen och dess egenskaper, med hjälp av matrisalgebra
- härleda och förklara instrumentvariabel-metoden
- utföra inferens på ekonometriska modeller med hjälp av minsta kvadratmetoden, maximum likelihoodmetoden
- formulera och genomföra statistiska tester, samt redogöra för de grundläggande idéerna bakom Lagrange Multiplier (LM), Likelihood Ratio (LR) och Wald testen
- analysera modeller med diskreta utfallsvariabler
- analysera modeller och utföra inferens på paneldatamodeller
- genomföra empiriska analyser med hjälp av mjukvara

Innehåll

Kursen innehåller:

- linjära och icke-linjära regressionsmodeller
- diagnostiska tester
- analys av tvärsnitt, tidsserier, och paneldata
- empiriska övningar med hjälp av mjukvara

Undervisningsformer

Kursen består av föreläsningar och övningar.

Examination

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

Kursen examineras genom en individuell skriftlig tentamen (7,5 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.

Omexamination 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.

I det fall student med funktionsnedsättning har rätt till särskilt pedagogiskt stöd beslutar examinator om anpassad eller alternativ examination.

Kursvärdering

Kursvärdering genomförs under kursen eller i nära anslutning till kursens avslutning. Resultat och analys av genomförd kursvärdering ska skyndsamt återkopplas till de studenter som genomfört kursen. Studenter som deltar vid nästa kurstillfälle ska senast vid kursstart informeras om föregående kursvärderingsresultat och genomförda förändringar i kursen.

Övrigt

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

Kurslitteratur och övriga läromedel

Obligatorisk litteratur

Wooldridge, J. M. *Introductory econometrics: a modern approach*. Wooldridge, South-Western College Publishing. Senaste upplaga. Cirka 820 sidor.

Föreläsninganteckningar. Cirka 300 sidor.

Vetenskapliga artiklar. Cirka 200 sidor.