



Linnéuniversitetet

Kalmar Växjö

Dnr 2019/1955-4.1.2.1

Kursplan

Ekonomihögskolan

3FNA027

Ekonometri 15 hp.

Econometrics 15 ECTS.

Huvudområde

Statistik

Ämne

Statistik

Nivå

Doktorandnivå

Fastställande

Fastställd av Ekonomihögskolans dekan 190620

Förkunskaper

Studenten ska vara antingen till en forskarutbildning i Företagsekonomi, Nationalekonomi, Statistik eller Matematisk statistik. 30 hp i statistik rekommenderas som minimikrav för att klara kursen. Grundläggande kunskaper i linjär algebra rekommenderas.

Mål

Efter avslutad kurs förväntas studenterna kunna:

Kunskap och förståelse

- Bedöma och värdera styrkor/svagheter med metodiken i kursen
- Recognize the common errors made in econometric analysis
- Diskutera begreppen ortogonaldekomposition vs teoribaserad syn på en ekonometrisk modell

Kunskap och färdigheter

- Bestämma en lämplig modell för ekonomisk data

- Utvärdera anpassningsgraden av en modell
- Beräkna relevanta punkt- och intervallskattningar
- Utföra test av fördelningsantagande
- Använda datorprogram för ekonometrisk analys
- Tillämpa robusta metoder

Bedömning och värdering

- Utvärdera fördelningsegenskaper för ekonomisk data
- Bedöma vilken metod som ska användas för ett givet problem
- Identifiera vanligt förekommande problem i ekonometrisk modellering

Innehåll

Kursen innehåller:

- Stochastic limit theory
- Linjär algebra
- Data genererande processer
- Den linjära regressionsmodellen
- Minsta kvadratmetoden
- Hypotestest och modellval
- Funktionell form och strukturella förändringar
- Ickelinjära och ickeparametriska regressionsmodeller
- Endogenitet och instrumentvariabelskattning
- Generaliserad regression
- Ekvationssystem
- Paneldataanalys
- Skattningsmetodik
- Trunkering, censurering och andra selektionsproblem
- Tidsserieanalys

Undervisningsformer

Undervisningen består av föreläsningar och datorövningar. Även seminarier kan ingå.

Standardtext:

Datum för obligatoriska moment framgår av schemat.

Undervisningsspråk: Engelska

Examination

Kursen bedöms med betygen Godkänd eller Underkänd

Kursen examineras genom inlämningsuppgifter.

Betyget G utgör det högsta betygssteget för att vara godkänd. Betyget U innebär att studentens prestationer bedöms som underkända. Studenter som ligger nära gränsen för godkänt betyg på rapporter kan få komplettera efter examinatorns anvisningar och

tidsangivelse för att uppnå godkänt resultat. Betygskriterier kommuniceras skriftligt till studenten senast i samband med kursstart.

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 kursvärderingen ska skyndsamt återkopplas till de studenter som genomfört kursen. Studenter som deltar vid nästa kurstillfälle erhåller återkoppling vid kursstart.

Kurslitteratur och övriga läromedel

Artiklar och bokkapitel:

Artiklar bestäms under kursens gång.

Böcker:

Econometric analysis, W. H. Greene, senaste upplagan