

Ekonometrisk analys

Fristående- och programkurs

7.5 hp

Econometric Analysis

730A08

Gäller från:

Fastställd av

Filosofiska fakultetens kvalitetsnämnd

Fastställandedatum

2011-02-18

Huvudområde

Nationalekonomi

Utbildningsnivå

Avancerad nivå

Fördjupningsnivå

A1X

Kursen ges för

- Internationella civilekonomprogrammet
- Civilekonomprogrammet

Förkunskapskrav

För tillträde till kursen krävs genomgången Nationalekonomi 3 eller motsvarande, samt genomgången grundkurs i Ekonometri motsvarande 7,5 ECTS poäng eller motsvarande kunskaper.

Lärandemål

Efter avslutad kurs skall den studerande kunna:

- praktiskt genomföra ekonometriska undersökningar med hjälp av den för frågeställningen mest relevanta ekonometriska metoden
- applicera ekonometriska metoder för att estimerar och testa modeller och därefter genomföra statistiska undersökningar och/eller prognosarbete inom typiska mikroekonomiska, makroekonomiska och finansiella problemställningar.

Kursinnehåll

Kursen innehåller praktiska tillämpningar på de teoretiska problem som diskuteras inom kursen Ekonometrisk teori. Den grundläggande linjära regressions modellen har ett mycket begränsat användningsområde. Exempel på moment som tas upp är paneldata där data består av en serie observationer över tiden av samma enhet, modeller där den beroende variabeln är censurerad eller begränsad i någon form så att den t.ex. aldrig kan vara negativ eller har två möjliga utfall typ noll (inget hände) eller ett (något hände). I samband med dessa modeller diskuteras också olika infallsvinklar på s.k. "sample selection" problem, dvs. observationer på den beroende variabel kan inte ses som genererade från ett slumpmässigt sample utan har genererats via någon icke-stockastisk process. Exempel på det senare är samplet bara består av variabler som gick att mäta som t.ex. lönerna hos kvinnor som förvärvsarbetar, eller samplet består enbart av de försökspersoner som frivilligt anmälde sig till att delta i experimentet.

Vidare behandlas de problem som uppstår vid modellerandet av icke-stationära variabler, dvs. variabler vars medelvärde och varians är funktioner av tiden. I detta sammanhang behandlas tester för s.k. "unit-roots" och "co-integration". Vidare behandlas AutoRegressive Integrerade Moving Average modeller (ARIMA), Vector AutoRegressiva (VAR) modeller, Vector Error Correction Modeller (VECM). Dessa modeller används till deskriptiv statistik, prognoser och för att testa kausalitet och ekonomiska hypoteser. Även modeller för tidsvarierande varianser Generalized AutoRegressive Heteroscedastic (GARCH) modeller behandlas.

Undervisnings- och arbetsformer

Kursen läses parallellt med Ekonometrisk Teori. Denna kurs, Ekonometrisk Analys innehåller praktiska applikationer (lärlädda laborationer) på de problemställningar som behandlas inom kursen Ekonometrisk Teori. Kursen innehåller datorövningar (E-views) med inslag av föreläsningar och individuell/grupp handledning. Utöver detta ska den studerande utöva självstudier.

Examination

Kursen examineras fortlöpande genom ett antal inlämningsuppgifter under kursen gång. Detaljerad information återfinns i studiehandledning/kurshemsida.

Betygsskala

Tregradig skala, U, G, VG

Övrig information

Planering och genomförande av kurs skall utgå från kursplanens formuleringar. Den kursvärdering som skall ingå i varje kurs skall därför behandla frågan om hur kursen överensstämmer med kursplanen. Kursen bedrivs på ett sådant sätt att både mäns och kvinnors erfarenhet och kunskaper synliggörs och utvecklas.

Institution

Institutionen för ekonomisk och industriell utveckling