



## EKONOMETRI

TEK190

### Econometrics

**Antal poäng:** 5. **Betygskala:** TH. **Valfri för:** I4IE. **Kursansvarig:** Professor David Edgerton. **Prestationsbedömning:** Undervisningen består av föreläsningar och lektioner. Examinationen är skriftlig och äger rum vid slutet av delkursen. Ytterligare provtillfälle anordnas i nära anslutning härtill. Obligatoriska övningsuppgifter kan förekomma inom kursen. **Webbsida:** <http://www.nek.lu.se>. **Övrigt:** För ytterligare information kontakta Nationalekonomiska institutionen.

### Mål

Målet med kursen är att ge förmåga att självständigt och kritiskt handskas med empiriskt material i ekonomiskt modellbyggande.

### Innehåll

Kursen ger den basen som behövs för att empiriskt analysera ekonomiska data. Moderna ekonometriska tekniker behandlas, samtidigt som stor vikt läggs på grundläggande ekonometriskt tänkande. Teorimoment varvas med tillämpningar i form av datorövningar.

#### *Teorimoment*

- Analys av den linjära regressionsmodellen särskilt minsta kvadratmetoden och hypotesprövning.
- Diagnostisk testing. Modelleringsstrategier när grundläggande antaganden måste förkastas.
- Skattning av mer komplicerade modeller med generaliserade minsta kvadratmetoden, maximum likelihood metoden samt instrument variabler. Prövning av icke linjära hypoteser.
- Dynamiska tidsseriemodeller samt icke stationära variabler.
- Tvärsnittsmodeller med diskreta och trunkerade beroende variabler.

Ett antal datorövningar ingår i kursen. Dessa omfattar delar av samtliga teorimoment redovisade ovan. Deltagande i datorövningar samt inlämnande av övningsresultat är obligatoriska.

### Litteratur

M. Verbeek, "A Guide to Modern Econometrics", Wiley & Sons, Chichester (2000),  
Recommended: P. Kennedy, "A Guide to Econometrics, 4th Edition", MIT Press,  
Cambridge (1998)