



EKONOMETRI

TEK190

Econometrics

Antal högskolepoäng: 7,5. **Betygskala:** TH. **Nivå:** G2 (Grundnivå, fördjupad).

Undervisningsspråk: Kursen ges på svenska. **Överlappar följande kurs/kurser:** NEK613, NEK615, NEKB23 och NEKB26. **Valfri för:** I4. **Kursansvarig:** Joakim Westerlund,

joakim.westerlund@nek.lu.se, Nationalekonomiska inst. **Förkunskapskrav:**

Grundläggande statistik. **Prestationsbedömning:** Examinationen är skriftlig och äger rum vid slutet av kursen. Ytterligare examinationstillfälle anordnas i nära anslutning härtill.

Datorövningarna är poänggivande. Poängen får tillgodoräknas vid examinationstillfället

under innevarande termin. Andra examinationsmoment kan förekomma. **Övrigt:**

Motsvarar NEK615. **Hemsida:** <http://www.nek.lu.se>.

Syfte

Syftet med kursen är att introducera grundläggande ekonometrisk teori och att ge studenterna färdigheter i att hantera grundläggande ekonometriska metoder.

Mål

Kunskap och förståelse

För godkänd kurs skall studenten

kunna:

- samla in och analysera data,
- förklara hur samband mellan ekonomiska variabler kan analyseras med hjälp av statistisk regressionsanalys,
- beskriva regressionsanalysens olika delar,
- härleda och formulera testbara ekonomiska hypoteser,
- ge regressionsanalysens resultat både en statistisk och ekonomisk tolkning,
- orientera sig i några mer avancerade ekonometriska metoder,
- generalisera sina kunskaper till ekonomiska problemställningar som inte behandlats under kursen,
- förstå relevant empirisk och ekonometrisk forskning.

Färdighet och förmåga

För godkänd kurs skall studenten

ha förmåga att självständigt:

- tillämpa regressionsanalysens verktyg på olika ekonomiska problem,
- testa ekonomiska hypoteser,
- utvärdera rimligheten i regressionsmodellens antaganden,
- implementera regressionsanalysen genom ett ekonometriskt mjukvaruprogram.

Värderingsförmåga och förhållningssätt

För godkänd kurs skall studenten

utveckla förmåga till vidare studier inom ämnet samt söka och utvärdera information med hög grad av självständighet. Studenten ska även utveckla förmåga att på egen hand skriva en empiriskt inriktad uppsats.

Innehåll

Kursen behandlar problem med att etablera och kvantifiera samband mellan olika ekonomiska variabler liksom grundläggande ekonometrisk metod. Huvudfokus ligger på den statistiska regressionsanalysen, men även mer avancerade metoder inom exempelvis tidsserieanalys berörs. En annan viktig del av kursen är de praktiska datorövningarna, vilka är tillämpningar på såväl mikro- och makroekonomi som finansiell ekonomi. Datorövningarna utförs på persondator med hjälp av ett ekonometriskt mjukvaruprogram.

Litteratur

Gujarati, D: Essentials of Econometrics, 3rd edition, McGraw-Hill, 2005, (ISBN 0-071-24448-4)

Special upplaga med Eviews CD

Westerlund, J: Introduktion till ekonometri, Studentlitteratur, 2005 (ISBN:91-44-03833-X) (rekommenderad)

Kompletterande material