

Kursplan för

Ekonometri Econometrics

**EXTG65, 7,5 högskolepoäng, G2
(Grundnivå, fördjupad)**

Gäller för: Läsåret 2017/18

Beslutad av: Programledning I

Beslutsdatum: 2017-04-10

Allmänna uppgifter

Valfri för: I4

Undervisningsspråk: Kursen ges på svenska

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.

Kursinnehåll

Kursen inleds med att ge en introduktion till deskriptiv statistik, sannolikhetslära och inferens. I övrigt behandlar kursen 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 tidserieanalys 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.

Kursens examination

Betygsskala: TH - (U,3,4,5) - (Underkänd, Tre, Fyra, Fem)

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.

Om så krävs för att en student med varaktig funktionsnedsättning ska ges ett likvärdigt examinationsalternativ jämfört med en student utan funktionsnedsättning, så kan examinator efter samråd med universitetets avdelning för pedagogiskt stöd fatta beslut om alternativ examinationsform för berörd student.

Antagningsuppgifter

Förkunskapskrav:

- FMS012 Matematisk statistik, allmän kurs eller FMSF45 Matematisk statistik, allmän kurs

Begränsat antal platser: Nej

Kursen överlappar följande kurser: NEKB23, NEKB26, NEKG31, TEK190

Kurslitteratur

- Ett av dessa tre program: EViews 8/ EViews 9.5 Student version , Stata eller Gretl.
- Dougherty, Christopher: Introduction to Econometrics, femte upplagan. Oxford University Press, 2016.
- Kompletterande material.

Kontaktinfo och övrigt

Kursansvarig: Peter Jochumzen, peter.jochumzen@nek.lu.se

Hemsida: <http://www.nek.lu.se>

Övrig information: Kursens ges av Nationalekonomiska institutionen och samläses med NEKG31. Tentamenstid meddelas av kursens föreläsare.