



EKONOMETRI

TEK190

Econometrics

Antal poäng: 5. **Betygskala:** TH. **Valfri för:** I4XFRS. **Kursansvarig:** Professor David Edgerton, Nationalekonomiska inst. **Förkunskapskrav:** Grundläggande statistik. **Prestationsbedömning:** Undervisningen består av föreläsningar och lektioner. Examinationen är skriftlig och äger rum vid slutet av kursen. Ytterligare provtillfälle anordnas i nära anslutning härtill. Obligatoriska övningsuppgifter kan förekomma inom kursen. **Övrigt:** För ytterligare information kontakta Nationalekonomiska institutionen. **Hemsida:** <http://www.nek.lu.se>.

Mål

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

Innehåll

Kursen ger den bas som behövs för att empiriskt analysera ekonomiska data. Moderna ekonometrisk 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 instrumentvariabler. Prövning av icke linjära hypoteser.

Dynamiska tidsseriemodeller samt icke stationära variabler.

Tvårsnittsmodeller 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

Verbeek, M: A Guide to Modern Econometrics. Wiley, 2nd ed. 2004.

Kennedy, P: A Guide to Econometrics. 5th edition, Blackwell Publishing 2003

(rekommenderad).