



Kursplan

för kurs på avancerad nivå

Ekometri 1

Econometrics 1

7.5 Höskolepoäng

7.5 ECTS credits

Kurskod: EC7410
Gäller från: HT 2014
Fastställt: 2013-05-23
Ändrad: 2014-10-03
Institution Nationalekonomiska institutionen

Ämne Nationalekonomi
Fördjupning: A1F - Avancerad nivå, har kurs/er på avancerad nivå som förkunskapskrav

Beslut

Denna kursplan är fastställd av Nationalekonomiska institutionens styrelse den 3 oktober 2014.

Förkunskapskrav och andra villkor för tillträde till kursen

För tillträde till kursen krävs antingen (1) att studenten är registrerad på Masterprogram i nationalekonomi eller Masterprogram i banking and finance vid Stockholms universitet eller (2) har (a) allmän behörighet för tillträde till utbildningsprogram på avancerad nivå, (b) särskild behörighet för tillträde till masterprogram i nationalekonomi vid Stockholms universitet samt (c) har förkunskaper motsvarande de obligatoriska kurser som har getts innan denna kurs enligt den gällande utbildningsplanen för masterprogrammet i nationalekonomi.

Kursens uppläggning

Provkod 741A
Benämning Ekometri 1

Höskolepoäng
7.5

Kursens innehåll

Kursen inleder med ett block med förberedande matrisalgebra och statistik. Här behandlas sannolikhets teori såsom stokastiska variabler, sannolikhetsfördelningar, väntevärden, oberoende urval, centrala gränsvärdesatsen, stora talens lag och konsistens. Vidare behandlas skattning av populationsmedelvärde, hypotestest och konfidensintervall. Därefter diskuteras den linjära regressionsmodellen under dess klassiska antaganden (OLS). Hypotesprövning och konfidensintervall för såväl enkel som multipel regression diskuteras. Olika typer av typiska problem för den linjära modellen som icke-linjär funktionsform, utelämnade och irrelevanta variabler, simultanitet, mätfel, heteroskedasticitet och autokorrelation analyseras. Dessutom ingår en översikt av tidsseriedata där autokorrelation, icke-stationaritet, prognoser, strukturella brott och enhetsrötter ingår.

Förväntade studieresultat

Efter att ha genomgått kursen förväntas studenten kunna:

1. förstå grundläggande sannolikhets teori,
2. förstå grundläggande statistiska begrepp,
3. förstå grundläggande multipel linjär regression,

4. förstå grundläggande tidsserieanalys,
5. tillämpa metoderna på empirisk data och tolka dess resultat.

Undervisning

Undervisningen sker i form av föreläsningar och gruppövningar. Undervisningsspråk är engelska.

Kunskapskontroll och examination

Kursen examineras genom skriftlig tentamen.

Betygssättning sker enligt en sjugradig målrelaterad betygsskala: För godkänt resultat finns betygen A, B, C, D och E där A är högst och E är lägst. För underkänt resultat finns F och FX, där F är lägre än FX.

Betygskriterier:

- A (Utmärkt): Studenten skall på ett uttömmande sätt och med ett självständigt och kritiskt resonemang kunna förklara de begrepp som behandlats på kursen. Kunna tillämpa metoderna på data och på verkliga ekonomiska problem med stor skicklighet.
- B (Mycket bra): Studenten skall med ett självständigt och kritiskt resonemang kunna förklara de begrepp som behandlats på kursen. Kunna tillämpa metoderna på data och på verkliga ekonomiska problem med skicklighet.
- C (Bra): Studenten skall i stort sett kunna förklara med ett självständigt och kritiskt resonemang de begrepp som behandlats på kursen. Kunna tillämpa metoderna på data och på verkliga ekonomiska problem.
- D (Tillfredsställande): Studenten skall i stort sett kunna förklara stora delar av de begrepp som behandlats på kursen. Kunna tillämpa metoderna på data och på verkliga ekonomiska problem.
- E (Tillräcklig): Studenten skall kunna förklara viktiga delar av de begrepp som behandlats på kursen.
- FX (Otilräckligt): Används inte som betyg på tentamen.
- F (Helt otilräckligt): Studenten kan inte förklara viktiga delar av de begrepp som behandlats på kursen. Visar bristande förmåga att kunna tillämpa metoder på data och verkliga ekonomiska problem.

Övergångsbestämmelser

Om kursen upphör ges möjlighet att examineras på kursen vid tre tillfällen under tre terminer efter det att kursen upphör.

Kurslitteratur

Se kurshemsidan via www.ne.su.se.