



Kursplan

för kurs på grundnivå

Empiriska metoder i nationalekonomin 3
Empirical methods in economics 3

7.5 Högskolepoäng
7.5 ECTS credits

Kurskod:	EC2405
Gäller från:	HT 2012
Fastställt:	2012-02-23
Institution	Nationalekonomiska institutionen
Huvudområde:	Nationalekonomi
Fördjupning:	G1F - Grundnivå, har mindre än 60 hp kurs/er på grundnivå som förkunskapskrav

Beslut

Denna kursplan är fastställd av Nationalekonomiska institutionsstyrelsen 23 februari 2012.

Förkunskapskrav och andra villkor för tillträde till kursen

Nationalekonomi I, 30 högskolepoäng samt EC2403 Empirical methods in economics 1, 7,5 högskolepoäng eller motsvarande förkunskaper.

Kursens uppläggning

Provkod	Benämning	Högskolepoäng
240A	Kursuppsats	5
240B	Inlämningsuppgifter	2
240C	Muntlig examination	0.5

Kursens innehåll

Kursen syftar till att nå en djupare förståelse av de statistiska metoder som behövs för att man empiriskt skall kunna analysera ekonomiska problem vilka involverar tidsseriedata. Kursen omfattar; OLS med tidsseriedata; autokorrelationsbegreppet; deterministisk trend; säsong; strukturella brott; inferens robust för heteroskedasticitet och autokorrelation; stationaritet; stokastisk trend; ADF-test; autoregressiva modeller; maximum-likelihood estimation; informationskriterier, moving average modeller; ARIMA-modeller; kointegration och error-correction-modeller; prognoser, Granger-kausalitet och prognosevärdering.

Förväntade studieresultat

Studenten skall efter avslutad kurs kunna

- * genomföra trend- och säsongrensning av tidsseriedata utan och med strukturella brott,
- * genomföra test för stationaritet och genom lämplig variabeltransformation göra data stationära,
- * estimerar en tidsseriemodell med OLS och genomföra hypotesprövning (t- och F-test) med robust inferens,
- * identifiera, estimerar och diagnosticera ARIMA-modeller,
- * testa för kointegration och estimerar och analyserar ECM-modeller,
- * med användning av under kursen genomgångna modeller utföra prognoser och utvärdera dessa.

Undervisning

Föreläsningar och övningar samt självstudier i datorlabb. Kursuppsatsen ventileras på ett pre-seminarium innan slutlig inlämning.

Kunskapskontroll och examination

Inlämningsuppgifter, kursuppsats, muntlig diskussionen på pre-seminarium av annan students kursuppsats.

Inlämninguppgifter omfattande 2 högskolepoäng utförs i grupp och examineras med betygen underkänd (U) eller godkänd (G). För G ska samtliga inlämningsuppgifter vara godkända.

Muntlig diskussion av annan students kursuppsatsutkast på pre-seminarium omfattande 0,5 högskolepoäng utförs individuellt och examineras med betygen underkänd (U) eller godkänd (G). För G ska diskussionen vara genomförd och godkänd.

Kursuppsats omfattande 5 högskolepoäng skrivs individuellt och examineras 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 FX. Betygskriterier (med regressionsanalys avses nedan under kursen genomgångna regressionsmetoder):

- * A (Utmärkt): Självständigt kunna genomföra ett empiriskt projekt med regressionsanalys och kunna tolka resultaten från en självständigt identifierad frågeställning. Ska kunna diskutera regressionsanalysens styrkor och problem, samt tydligt koppla den uppställda frågeställningen till den empiriska analysen.
- * B (Mycket bra): Självständigt kunna genomföra ett empiriskt projekt med regressionsanalys och kunna tolka resultaten. Ska kunna diskutera regressionsanalysens styrkor och problem, samt visa en tydlig koppling mellan uppställd frågeställning och empiriskt analys.
- * C (Bra): Självständigt kunna genomföra ett empiriskt projekt med regressionsanalys och kunna tolka resultaten. Ska visa förståelse för regressionsanalysens styrkor och problem.
- * D (Tillfredsställande): Självständigt kunna genomföra ett empiriskt projekt hjälp med regressionsanalys och kunna tolka resultaten.
- * E (Tillräckligt): Kunna genomföra ett empiriskt projekt med hjälp av regressionsanalys och hjälpligt tolka resultaten.
- * FX (Otillräckligt): Uppfyller kraven för E, men har inte beaktat önskemål om ett förtydligande eller komplettering av kursuppsats.
- * F (Helt otillräckligt): Uppfyller inte kraven för E.

För betyg på hela kursen gäller att

- * om inlämningsuppgifter och diskussion av kursuppsats båda examinerats med G bestäms kursbetyget av betyget på kursuppsatsen och
- * om inlämningsuppgifter eller diskussion av kursuppsats examinerats med U blir kursbetyget F oberoende av betyget på kursuppsatsen.

För student som fått betyget FX eller F på ett prov finns inga restriktioner på hur många gånger man får genomgå prov för att uppnå lägst betyget E.

Övergångsbestämmelser

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

Kurslitteratur

- * James H. Stock & Mark M. Watson, Introduction to econometrics, Pearson education, senaste upplagan.
- * Artiklar.

* Föreläsningsanteckningar.