



Ekonomihögskolan

EKHM85, Tillämpad tidsserieanalys, 7,5 högskolepoäng

Applied Time Series Analysis, 7.5 credits

Avancerad nivå / Second Cycle

Fastställande

Kursplanen är en historisk, äldre version, faställd av Institutionsstyrelsen vid Ekonomisk-historiska institutionen 2016-10-11 och gällde från och med 2017-01-16, vårterminen 2017.

Allmänna uppgifter

Detta är en kurs på avancerad nivå som kan bli en del av en masterexamen. Den är valbar andra året på masterprogrammen EAETU Ekonomisk tillväxt, befolkningsstudier och utveckling, EAETU Ekonomisk utveckling och tillväxt, EAISD Innovation och rumslig dynamik samt EAGCH Internationell ekonomi med fokus på Kina. Den kan också läsas som enskild kurs.

Huvudområde

Ekonomisk historia

Fördjupning

A1N, Avancerad nivå, har endast kurs/er på grundnivå som förkunskapskrav

Kursens mål

På en generell nivå ska studenterna förvärva fördjupad kunskap i användandet av tidsserieanalystekniker såsom kointegration och paneldataregression på ekonomiska problem.

Efter genomgången kurs förväntas studenterna kunna:

Kunskap och förståelse

- ha en fördjupad förståelse för panelanalys av mikro och makrodata
- ha en fördjupad förståelse för univariat tidsserieanalys i dataseriens nivåer och förstadifferenser

- förstå hur enhetsrothypoteser formuleras och testas i univariata modeller
- ha förståelse för multivariat tidsserieanalys i nivåer och förstadifferenser
- ha en fördjupad förståelse för kointegrationsanalys

Färdighet och förmåga

- tillämpa avancerade ekonometriska verktyg på ekonomiska problem med hjälp av tidsserier
- välja en lämplig tidsseriemodell för att analysera ett specifikt problem
- utvärdera om de antaganden som gjorts av den valda modellen är rimliga
- tillämpa rationella modelleringsstrategier även när grundläggande antaganden måste förkastas
- implementera ekonometriska analyser av tidsserier med ekonometrisk programvara, redogöra för och diskutera sina förmågor inom tidsserieanalys och lämpligheten av olika metoder och tidsserier för analys av ekonomiska problem
- utföra vidare studier inom ämnet samt kunna söka och utvärdera information med hög grad av självständighet
- individuellt skriva en empiriskt inriktad uppsats på masternivå med hjälp av tidsseriemetoder

Värderingsförmåga och förhållningssätt

- kunna formulera och testa hypotesen om kointegration i både singel-ekvation och multivariata tidsseriemodeller
- kunna formulera och testa hypoteser om kointegration och vektormodeller
- kunna generalisera sina kunskaper till ekonomiska problemställningar som inte behandlats under kursen
- kunna förstå relevant empirisk och ekonometrisk forskning

Kursens innehåll

Innehållet i kursen utgörs av både undervisning och kurslitteratur. Kursen ger en introduktion till grundläggande begrepp inom tidsserieanalys. Multivariat tidsserieanalys är baserad på VAR-modellerna. Icke-stationära tidsserier analyseras med enhetsrotttest, kointegrationsmetoder och VEC-modeller. Teoretiska studier varvas med praktiska tillämpningar inom demografi och ekonomisk historia.

Kursens genomförande

Kursen är utformad som en serie föreläsningar och datorövningar.

Kursens examination

Betygssättningen är baserad på individuella prestationer på övningar och inlämningsuppgift. Skriftliga tentamina kommer att erbjudas vid mer än ett tillfälle. Alla sådana prov kommer att bedömas enligt ordinarie förfarande.

Universitetet ser allvarigt på plagiat. Försök till plagiat, eller annat fusk kommer att anmälas till universitetets disciplinnämnd. Påföljden kan vara kortare eller längre avstängning från universitetet.

Betyg

Betygsskalan omfattar betygsgraderna Underkänt, E, D, C, B, A.

Vid Ekonomihögskolan tillämpas en målrelaterad betygsskala UA med bokstavsbeteckningarna A-E för godkända resultat och bokstavsbeteckningen U för icke godkända resultat.

A: Utmärkt

B: Mycket bra

C: Bra

D: Tillfredsställande

E: Tillräckligt

U: Otillräckligt

Betyg (Benämning) Karakteristik

A (Utmärkt). Ett framstående resultat som är utmärkt vad gäller teoretiskt djup, praktisk relevans, analytisk förmåga och självständighet.

B (Mycket bra). Ett mycket bra resultat som karakteriseras av mycket bra teoretiskt djup, praktisk relevans, analytisk förmåga samt självständighet.

C (Bra). Ett bra resultat som karakteriseras av bra teoretiskt djup, praktisk relevans, analytisk förmåga samt självständighet.

D (Tillfredsställande). Ett resultat som är tillfredsställande vad gäller teoretiskt djup, praktisk relevans, analytisk förmåga och självständighet.

E (Tillräckligt). Ett resultat som möter minimikraven vad gäller teoretiskt djup, praktisk relevans, analytisk förmåga och självständighet, men inte mer.

U (Otillräckligt/Underkänt). Ett resultat som är otillräckligt vad gäller teoretiskt djup, praktisk relevans, analytisk förmåga och självständighet.

För att få godkänt på en kurs måste studenten få betyg E eller högre.

Student som ej uppnått betyget A-E har, om kursen examineras med salstentamen, rätt till omtentamen där studenten bedöms enligt samma kriterier som vid ordinarie examinationstillfälle. I de fall då examinationen sker med hemuppgifter gäller att uppgifter som lämnas in efter överenskommen tidpunkt behandlas på något av följande sätt: a) en ny hemuppgift delas ut, vilken bedöms enligt samma kriterier som vid ordinarie examination, b) den inlämnade uppgiften behandlas men riskerar

poängavdrag för sen inlämning såvida studenten inte kan påvisa speciella skäl till förseningen.

Förkunskapskrav

Antagning till denna kurs är öppen för studenter på masterprogrammen EAETU Ekonomisk tillväxt, befolkningsstudier och utveckling, EAETU Ekonomisk utveckling och tillväxt, EAISD Innovation och rumslig dynamik samt EAGCH Internationell ekonomi med fokus på Kina, liksom för doktorander i ekonomisk historia som har gått kursen EKHM62 eller som någon annanstans har förvärvat motsvarande kunskaper.

Övrigt

Kursen hade tidigare kurskoderna EKHP07 och EKHM44 får inte tillgodoräknas i en examen tillsammans med någon av dessa kurser.