



LUNDS
UNIVERSITET

Ekonomihögskolan

NEKN31, Nationalekonomi: Avancerad Ekonometri, 7,5 högskolepoäng

Economics: Advanced Econometrics, 7.5 credits
Avancerad nivå / Second Cycle

Fastställande

Kursplanen är fastställd av Institutionsstyrelsen vid Nationalekonomiska institutionen 2011-06-07 och senast reviderad 2015-11-04. Den reviderade kursplanen gäller från och med 2015-11-04, höstterminen 2016.

Allmänna uppgifter

Kursen är en fristående kurs i ämnet nationalekonomi. Kursen ingår som valfri eller obligatorisk delkurs inom flera magister- och masterprogram inom Lunds universitet.

Undervisningsspråk: Engelska

Undervisningen kan ske på svenska om alla registrerade studenter behärskar svenska.

Huvudområde

Nationalekonomi

Fördjupning

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

Kursens mål

1. Kunskaper och förståelse

Studenten ska:

- ha en fördjupad förståelse för den linjära regressionsmodellen, inklusive dennas representation med hjälp av matrisalgebra,
- kunna skatta linjära och icke-linjära modeller med hjälp av minsta kvadratmetoden, generaliserade minsta kvadratmetoden, maximum likelihood-metoden och instrumentvariabler, samt ha en förståelse för när dessa olika metoder ska användas,
- kunna formulera och pröva linjära och icke-linjära hypoteser,
- kunna analysera tvärsnittsmodeller med diskreta och trunkerade beroende variabler,
- kunna analysera stationära och icke-stationära tidsseriemodeller,
- kunna analysera paneldatamodeller,

- kunna generalisera sina kunskaper till ekonomiska problemställningar som inte behandlats under kursen,
- kunna förstå relevant empirisk och ekonometrisk forskning.

2. Färdighet och förmåga

Studenten ska ha förmåga att självständigt:

- tillämpa avancerade ekonometriska verktyg på olika ekonomiska problem,
- utvärdera rimligheten i den valda modellens antaganden,
- tillämpa rationella strategier för att välja modell även när grundläggande antaganden måste förkastas,
- implementera ekonometriska analyser med hjälp av ett ekonometriskt mjukvaruprogram,
- redogöra för och diskutera sitt ekonometriska kunnande.

3. Värderingsförmåga och förhållningsätt

Studenten ska 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.

Kursens innehåll

Kursen ger den bas som behövs för att empiriskt analysera ekonomisk data utan att göra orealistiska antaganden. Moderna ekonometriska tekniker behandlas samtidigt som stor vikt läggs på grundläggande ekonometriskt tänkande. Teorimoment varvas med tillämpningar i form av datorövningar som utförs på persondator med hjälp av ett ekonometriskt mjukvaruprogram.

Kursens genomförande

1. Undervisningsform: Undervisningen består av föreläsningar och obligatoriska datorövningar.

Kursens examination

1. Examinationsuppgifter: 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 i mindre utsträckning.

2. Begränsning av antal examinationstillfällen: –

Lunds universitet ser mycket allvarligt på fusk och kommer att vidta disciplinåtgärder mot alla slags försök till fusk i samband med tentamina eller andra examinationsformer. Plagiering betraktas som ett mycket allvarligt akademiskt brott. Det straff som universitetet kan utdela för detta, och för andra slags fusk i samband

med olika former av examination, inkluderar avstängning från universitetet under en viss tidsperiod.

Prov/moment för denna kurs finns i en bilaga i slutet av dokumentet.

Betyg

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

1. Betygsskala: Betyg (Benämning), Poäng alternativt procent av maxpoäng, Karakteristik

A (Utmärkt), 85–100, Ett framstående resultat som är utmärkt vad gäller teoretiskt djup, praktisk relevans, analytisk förmåga och självständighet.

B (Mycket bra), 75–84, Ett mycket bra resultat som karakteriseras av mycket bra teoretiskt djup, praktisk relevans, analytisk förmåga samt självständighet.

C (Bra), 65–74, Ett bra resultat som karakteriseras av bra teoretiskt djup, praktisk relevans, analytisk förmåga samt självständighet.

D (Tillfredsställande), 55–64, Ett resultat som är tillfredsställande vad gäller teoretiskt djup, praktisk relevans, analytisk förmåga och självständighet.

E (Tillräckligt), 50–54, Ett resultat som möter minimikraven vad gäller teoretiskt djup, praktisk relevans, analytisk förmåga och självständighet, men inte mer.

U (Otilräckligt/Underkänt), 0–49, Ett resultat som är otillräckligt vad gäller teoretiskt djup, praktisk relevans, analytisk förmåga och självständighet.

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

2. Sammanvägning av betyg: –

3. Betygsskalor för olika delar av kursen: –

Förkunskapskrav

Studenter som har antagits till masterprogrammet i nationalekonomi (Master Programme in Economics – two years) eller till masterprogrammet i forskningsmetoder för nationalekonomi (Master Programme in Economic Research Methods) och som har läst kursen "Avancerad mikroekonomisk analys" är behöriga att läsa denna kurs. För övriga studenter krävs minst 60 högskolepoäng i nationalekonomi på grundnivå, varav kursen "Mikroekonomisk analys" och kursen "Ekonometri" eller motsvarande måste ingå för tillträde till denna kurs.

Övrigt

1. Övergångsregler: Kursen ersätter NEKM23 "Avancerad ekonometri".

2. Begränsning i giltighetstid: –

3. Begränsningar: Kursen får inte ingå i samma examen som NEK711 "Ekonometri D" eller NEKM23 "Avancerad ekonometri".

4. Liknande kurser: –

5. Begränsning av förnyad examination: –

Prov/moment för kursen NEKN31, Nationalekonomi: Avancerad Ekonometri

Gäller från H11

1101 Avancerad ekonometri, 7,5 hp
Betygsskala: Underkänt, E, D, C, B, A