



Ekonomihögskolan

EKHM44, Ekonomisk historia: Avancerad tidsserieanalys, 7,5 högskolepoäng

Economic History: Advanced Time Series Analysis, 7.5 credits
Avancerad nivå / Second Cycle

Fastställande

Kursplanen är fastställd av Institutionsstyrelsen vid Ekonomisk-historiska institutionen 2012-12-11 att gälla från och med 2013-01-01, vårterminen 2013.

Allmänna uppgifter

Detta är en master/forskarutbildningskurs som är frivillig i de mastersprogram som erbjuds av Institutionen för ekonomisk historia. Den ger en progression från kursen EKHM25 (Ekonometri).

Undervisningsspråk: Engelska

Huvudområde

Ekonomisk historia

Fördjupning

A1F, Avancerad nivå, har kurs/er på avancerad nivå 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:

Kunskap och förståelse

- ha en fördjupad förståelse för univariat tidsserieanalys i dataseriens nivåer och förstadifferenser
- förstå hur enhetsrot-hypoteser formuleras och testas i univariata modeller
- ha förståelse för multivariat tidsserieanalys i nivåer och förstadifferenser

- ha en fördjupad förståelse för kointegrationsanalys
- ha en förståelse för analysen av antingen volatilitet i en univariat tidsserie eller enhetsrötter och kointegration i paneldatamodeller

Färdighet och förmåga

Efter genomgången kurs förväntas studenterna kunna:

- tillämpa avancerade ekonometriska verktyg på ekonomiska problem med hjälp av tidsserier
- välja en lämplig tidsserie modell för att analysera ett specifikt problem
- utvärdera om de antaganden som gjorts av den valda modellen är rimliga
- tillämpa rationell 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 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 mastersnivå med hjälp tidsseriemetoder.

Värderingsförmåga och förhållningssätt

Efter genomgången kurs förväntas studenterna kunna:

- formulera och testa hypotesen om ko-integration i både singel-ekvation och multivariata tidsseriemodeller
- formulera och testa hypoteser om ko-integration och vektormodeller
- 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. Den univariata analysen av tidsserier i denna kurs är baserad på ARMA/VARIMA modeller. Multivariat tidsserieanalys är baserad på VAR-modellerna. Icke-stationära tidsserier analyseras med enhetsrötstester, kointegrationsmetoder och VEC-modeller. Studenterna kan välja att specialisera sig på att analysera volatilitetsmodeller eller icke-stationära paneldatamodeller. Teoretiska studier varvas med praktiska tillämpningar inom demografi och makroekonomi

Kursens genomförande

Kursen är utformad som en serie föreläsningar och datorövningar.

Kursens examination

Betygssättning är baserad på individuella prestationer på övningar och inlämningsuppgift. Skriftliga tentamen 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 universitets disciplinnämnd. Påföljden kan vara längre eller kortare avstängning från universitetet.

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

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	KARAKTERISTIK	KRITERIER
A	Utmärkt	Ett framstående resultat som är utmärkt vad gäller teoretiskt djup, ämnesrelevans, analytisk förmåga och självständighet.

B	Mycket bra	Ett mycket bra resultat som karakteriseras av mycket bra teoretiskt djup, ämnesrelevans, analytisk förmåga samt självständighet.
C	Bra	Ett bra resultat som karakteriseras av bra teoretiskt djup, ämnesrelevans, analytisk förmåga samt självständighet.
D	Tillfredsställande	Ett resultat som är tillfredsställande vad gäller teoretiskt djup, ämnesrelevans, analytisk förmåga och självständighet.
E	Tillräckligt	Ett resultat som möter minimikraven enligt ovanstående, men inte mer.
U	Otillräckligt	Ett resultat som är otillräckligt.

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 mastersprogram som erbjuds av institutionen för ekonomisk historia, liksom doktorander i ekonomisk historia, som har gått kursen EKHM25 (Ekonometri) eller någon annanstans har förvärvat motsvarande kunskaper.

Övrigt

Kursen hade tidigare kurskoden EKHP07 (Avancerad tidsserieanalys) och får inte tillgodoräknas i en examen tillsammans med denna kurs.

Prov/moment för kursen EKHM44, Ekonomisk historia: Avancerad
tidsserieanalys

Gäller från V12

1101 Advanced Time Series Analysis, 7,5 hp
Betygsskala: Underkänt, E, D, C, B, A