



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 2023-10-17. Den reviderade kursplanen träder i kraft 2023-10-17 och gäller från och med vårterminen 2024.

Allmänna uppgifter

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

Undervisningsspråk: Engelska

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

Huvudområde *Fördjupning*

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

Kursens mål

Kunskap 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 tvärsnittsmoeller 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.

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.

Värderingsförmåga och förhållningssätt

Studenten ska ha förmåga till vidare studier inom ämnet samt kunna söka och utvärdera information med hög grad av självständighet. Studenten ska även ha tillräckliga färdigheter för att på egen hand skriva ett empiriskt inriktat arbete på magisternivå.

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 övningar.

Kursens examination

1. Examinationsuppgifter: Examinationen består av en skriftlig tentamen och poänggivande övningar. Den skriftliga tentamen äger rum vid slutet av kursen. Ytterligare examinationstillfälle anordnas i nära anslutning härtill. Poängen från övningarna får tillgodoräknas vid examinationstillfällena 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.

Om så krävs för att en student med varaktig funktionsnedsättning ska ges ett likvärdigt examinationsalternativ jämfört med en student utan funktionsnedsättning, så kan examinator efter samråd med universitetets avdelning för pedagogiskt stöd fatta beslut om alternativ examinationsform för berörd student.

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 (Otillräckligt/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) är behöriga att läsa denna kurs. För övriga studenter krävs minst 90 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: –