



# INSTITUTIONEN FÖR NATIONALEKONOMI MED STATISTIK

## NEF1001 Ekonometri I, 9 högskolepoäng

Econometrics I, 9 credits

*Forskarnivå / Third-cycle level*

---

### Fastställande

Kursplanen är fastställd av Institutionen för nationalekonomi med statistik 2018-12-06 att gälla från och med höstterminen 2018.

#### *Ansvarig institution*

Institutionen för nationalekonomi med statistik, Handelshögskolans fakultet

### Förkunskapskrav

För tillträde till kursen krävs antagning till forskarutbildning vid Institutionen för nationalekonomi med statistik, Göteborgs universitet, eller på annan institution, fakultet eller universitet.

Doktorandkursen Mathematics är ett krav för behörighet till kursen och för masterstudenter och doktorander vid andra institutioner kan även andra förkunskapskrav tillkomma.

### Lärandemål

Efter avslutad kurs förväntas doktoranden:

#### *Kunskap och förståelse*

- förstå de viktigaste elementen i statistik och ekonometri.
- förstå begreppet kausalitet och förstå när och hur kausala relationer kan identifieras ur de tillgängliga datamängderna.
- förstå de grundläggande begreppen för estimeringsmetoder såsom Generaliserade momentmetoden (GMM) och Maximum likelihood-metoden (ML).
- känna till de modeller som bör användas vid begränsad tillgänglighet av data samt de antaganden som gjorts av dessa modeller.

#### *Färdighet och förmåga*

- kunna tillämpa de viktigaste elementen i statistik och ekonometri inom ramen för sin egen

forskning.

- kunna visa när modellparametrar kan identifieras baserat på tillgängliga data.
- kunna välja vilka modeller och estimeringsmetoder som bör användas i sin egen forskning.

### ***Värderingsförmåga och förhållningssätt***

- kunna förstå och kritisera ekonometrisk forskning.

## **Innehåll**

Kursen innehåller följande ämnen:

1. Linjär och icke-linjär regression
2. Endogenitet och IV-estimering
3. Estimeringsmetoderna Generaliserade momentmetoden (GMM) och Maximum likelihoodmetoden (MLE)
4. Paneldatamodeller
5. Limited dependent variable (LDV) och urvalsmodeller.

## **Undervisningsformer**

Kursen består av föreläsningar och övningstillfällen.

### ***Undervisningsspråk***

Kursen ges på engelska.

## **Betyg**

På kursen ges något av betygen Godkänd (G) och Underkänd (U).

## **Former för bedömning**

Kursen examineras genom en salsskrivning och tre skriftliga uppgifter.

Student äger rätt till byte av examinator efter att ha underkänts två gånger på examinationen, om det är praktiskt möjligt. En skriftlig begäran ställs till Proprefekten för Institutionen för nationalekonomi med statistik.

## **Kursvärdering**

En skriftlig anonym kursutvärdering görs i slutet av kursen. Resultatet av utvärderingen kommuniceras till studenterna och kommer att vara vägledande i kommande kursutveckling.

## **Övrigt**

Studenter från andra fakulteter eller universitet ansöker om antagning till kursen hos prefekten vid institutionen för nationalekonomi med statistik.

Bilaga 1: Litteraturlista