



INSTITUTIONEN FÖR NATIONALEKONOMI MED STATISTIK

NEF1002 Ekonometri II, 7,5 högskolepoäng

Econometrics II, 7.5 credits

Forskarnivå / Third-cycle level

Fastställande

Kursplanen är fastställd av Institutionen för nationalekonomi med statistik 2018-12-06 att gälla från och med vårterminen 2019.

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.

Lärandemål

Efter avslutad kurs förväntas doktoranden kunna:

Kunskap och förståelse

- förstå de teoretiska grunderna för vanliga ekonometriska metoder

Färdighet och förmåga

- förstå och härleda de asymptotiska egenskaperna av de mest vanligt förekommande ekonometriska estimatorerna, inklusive extremumestimatorer
- läsa någorlunda avancerade forskningsartiklar i ekonometrisk teori med tillräcklig förståelse för att implementera många icke-standard metoder

Värderingsförmåga och förhållningssätt

- få en mer samlad bild av ekonometriska metoder, och komma bortom "kokbokförståelsen" för ekonometrisk inferens där varje metod behandlas var för sig

Innehåll

Kursen ger en mellanliggande till avancerad behandling av ekonometriska metoder för analys av tvärsnitts- såväl som tidsseriedata. Följande punkter avhandlas:

- (i) Regressioner som projektioner och optimalitetsegenskaperna av minstakvadratmetoden;
- (ii) Konvergens i sannolikhet och konvergens i fördelning;
- (iii) Introduktion av tidsseriemetoder, inklusive univariata AR och MA modeller. Ämnen såsom prognosmakeri och modellselektion introduceras. Multivariata VAR-modeller, och de relaterande koncepten Grangerkausalitet, impulsresponser, variansdekomponeringar, och strukturella VAR-modeller diskuteras också. Icke-stationär data och processer behandlas ytligt.
- (iv) Konvergens och asymptotisk normalfördelning av minstakvadratmetodsestimatorer tillämpade på icke-oberoende observationer. Härledning av variansestimatorer för heteroskedastiska och autokorrelerade datamängder.
- (v) Konvergens och asymptotisk normalfördelning av extremumestimatorer.

Undervisningsformer

Kursen består av föreläsningar.

Undervisningsspråk

Kursen ges på engelska.

Betyg

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

Former för bedömning

Inlämningsuppgifter: Det finns fyra stycken inlämningsuppgifter. Dessa kommer ej att betygsättas, men inlämning är obligatorisk.

Tenta: Tentan kommer att täcka de ämnen som behandlats i föreläsningar och inlämningsuppgifter.

För att erhålla betyget Godkänd måste studenten uppnå minst 50% av maxpoängen på tentan.

En omtenta ges några veckor och senast nio månader efter den ordinarie tentan.

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

Kursen baseras på föreläsningsanteckningar och forskningsartiklar. Hayashi (2000) tjänar som kompletterande läsning.

Hayashi, F., (2000), *Econometrics*. Princeton: Princeton University Press.

Antal sidor: Ungefär 700.

Bilaga 1: Litteraturlista

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