



Statistiska institutionen

KURSPLAN FÖR EKONOMETRI, 5 POÄNG

Econometrics

1. Beslut

Kursplan för Ekonometri, 5 poäng. Fastställd av institutionsstyrelsen 2005-08-30. Denna kursplan gäller fr o m HT 2005.

2. Förkunskapskrav

För att få gå kursen krävs godkänd kurs Finansiell statistik, 10 poäng, vilken ingår i inriktning finansiering på Ekonomlinjen 120/160 poäng vid Stockholms universitet eller motsvarande.

3. Utbildningens mål

Kursens mål är att

- ge grundläggande kunskaper i regression och tidsserieanalys
- studenterna ska kunna uttrycka ekonomisk och finansiell teori i en ekonometrisk modell
- studenterna ska kunna estimerar en lämplig ekonometrisk modell, analysera resultaten och även vara medvetna om begränsningar och eventuella felkällor i analysen.

4. Kursens uppläggning

Kursen består av följande moment:

Ekonometri, 5 poäng

5. Utbildningens innehåll

Introduktion till regressionsanalys. Enkel och multipel regression. Hypotesprövning. Stegvis regression. Val av bästa modell. Finansiella tillämpningsexempel. Multikollinearitet. Heteroskedastisitet. Autokorrelation. Ekonometriska tidsserier. Diagnostik och prognoser.

Undervisningen kan bestå av föreläsningar, övningar, seminarier, laborationer och handledning.

Examinationen består vanligen av skriftliga prov och inlämningsuppgifter. Muntlig examination kan förekomma.

6. Obligatorisk undervisning

Viss obligatorisk närvaro och andra obligatoriska inslag kan förekomma.

7. Kunskapskontroll och betygssättning

Som betyg på kursen ges antingen Väl godkänd, Godkänd eller Underkänd. Studerande som har samtliga prov och inlämningsuppgifter godkända får för kursen något av betygen Godkänd eller Väl godkänd.

För studerande som underkänts vid ordinarie provtillfälle ordnas ytterligare provtillfälle i nära anslutning till detta. Antalet ytterligare provtillfällen utöver dessa två är begränsat till tre om kursen upphör eller ändras. I detta fall garanteras ej några provtillfällen mer än 13 månader efter kursens slut.

Studerande som har underkänts två gånger i prov på kursen eller på del av kursen har rätt att begära annan examinator. Sådan begäran skall göras hos institutionsstyrelsen.

Den som en gång godkänts i ett prov får ej genomgå förnyat prov för högre betyg.

8. Kurslitteratur

Enligt särskild förteckning.

9. Övrigt

Ekonometri, 5 poäng, ingår som delmoment i momentet Statistisk teori FK, 10 poäng på fortsättningskurs i statistik, 20 poäng.