



AH2002 Econometrics 7,5 hp

Econometrics

När kurs inte längre ges har student möjlighet att examineras under ytterligare två läsår.

Fastställande

Kursplan för AH2002 gäller från och med HT10

Betygsskala

A, B, C, D, E, FX, F

Utbildningsnivå

Avancerad nivå

Huvudområden

Industriell ekonomi

Särskild behörighet

Högskolestudier om minst 180hp därav minst 30hp inom matematik/nationalekonomi samt dokumenterade kunskaper i engelska B eller motsvarande.

.

Undervisningsspråk

Undervisningsspråk anges i kurstillfällesinformationen i kurs- och programkatalogen.

Lärandemål

Efter genomgången kurs ska studenten ha lärt sig att organisera data, formulera en matematisk modell i en empiriskt testbar form, estimerar och testa modeller med observerbara data, tolka resultaten samt använda modellerna för prediktion och policy slutsatser

Kursinnehåll

- Enkel och multipel linjär regressionsmodell.
- Hypotestestning, prediktion, tester och förklaringsgrad.
- Icke-linjära modeller, heteroskedasticitet, endogenitet, dynamiska modeller och simultana ekvationssystem.
- Stationära och icke-stationära tidsserier samt kointegration.
- Paneldata och kvalitativa modeller.

Kurslitteratur

Carter Hill, R., Griffiths, W.E., Lim, G.C. (2008) **Principles of Econometrics**, 3rd Edition, Wiley.

Examination

- INL1 - Term Paper, 1,5 hp, betygsskala: A, B, C, D, E, FX, F
- TEN1 - Examination, 4,5 hp, betygsskala: A, B, C, D, E, FX, F
- ÖVN1 - Exercises, 1,5 hp, betygsskala: A, B, C, D, E, FX, F

Examinator beslutar, baserat på rekommendation från KTH:s handläggare av stöd till studenter med funktionsnedsättning, om eventuell anpassad examination för studenter med dokumenterad, varaktig funktionsnedsättning.

Examinator får medge annan examinationsform vid omexamination av enstaka studenter.

Inlämningsuppgifter och skriftlig tentamen

Övriga krav för slutbetyg

Passed assignments and passed written exam

Etiskt förhållningssätt

- Vid grupparbete har alla i gruppen ansvar för gruppens arbete.
- Vid examination ska varje student ärligt redovisa hjälp som erhållits och källor som använts.
- Vid muntlig examination ska varje student kunna redogöra för hela uppgiften och hela lösningen.

