



ME2710 Tillämpad ekonometri

7,5 hp

Applied Econometrics

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

Fastställande

Kursplan för ME2710 gäller från och med HT14

Betygsskala

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

Utbildningsnivå

Avancerad nivå

Huvudområden

Industriell ekonomi

Särskild behörighet

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

Undervisningsspråk

Undervisningsspråk anges i kurstillfällesinformationen i kurs- och programkatalogen.

Lärandemål

Efter avslutad kurs ska deltagarna kunna:

- Behärska aktuella tekniker för paneldataanalyser, speciellt teknik för seriekorrelation, Seemingly Unrelated Regressions (SUR), simultana ekvationer, dynamiska modeller, limited dependent variabler och ickestationära paneler
- Genomföra och på ett pedagogiskt sätt presentera paneldataanalyser
- Visa på en grundläggande teoretisk förståelse av statistiska egenskaperna som kännetecknar olika paneldatamodeller
- Ha praktiska kunskaper och insikt i modern forskningsmetodik i form av linjära och icke-linjära skattningsmetoder för paneldata

Kursinnehåll

- Grundläggande STATAkommandon
- Grundläggande linjär regression
- Generalized Least Square (GLS) regressioner
- Linjära instrumentvariabelskattningar
- Grundläggande och avancerade paneldatamodeller
- Binominala och Multinominala modeller
- Selektionsmodeller
- Modeller baserade på poissonfördelning
- Tidsseriemodeller

Kurslitteratur

Cameron, A.A., Trivedi, P.K. (2010) Mikroekonometrics Using Sata, revised Edition, Stata Press

Baltagi, B. (201) Econometric Analysis of Panel Data, forth edition. Wiley

Examination

- TEN1 - Tentamen, 5,0 hp, betygsskala: A, B, C, D, E, FX, F
- ÖVN1 - Övningar, 2,5 hp, betygsskala: P, 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.

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.