



# AH2010 Econometrics II 7,5 hp

## Econometrics II

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

## Fastställande

Kursplan för AH2010 gäller från och med HT11

## Betygsskala

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

## Utbildningsnivå

Avancerad nivå

## Huvudområden

## Särskild behörighet

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

Grundkursen i ekonometri (AH2002) eller motsvarande rekommenderas

## Undervisningsspråk

Undervisningsspråk anges i kurstillfällesinformationen i kurs- och programkatalogen.

## Lärandemål

Kursen erbjuder en mångsidig tillämpning av ekonometri baserad på mikrodata över företag och individer samt simulerad data. Kursens fokus är nödvändig teoretisk förståelse för god praktisk tillämpning och tyngdpunkten ligger på tillämpning. Förväntade förkunskaper är en god insikt i linjära regressionsmodeller och baskunskaper i matisalgebra motsvarande grundkurser i ekonometri/kvantitativ analys (tex Wooldridge: Introductory Econometrics; Hill, Griffiths Lim: Principles of Econometrics. Kursen förutsätter också grundläggande kunskaper i STATA eller motsvarande statistiska programvara.

Lärandemål: Kursen behandlar olika grundläggande estimeringsmetoder såsom minsta kvadratmetoden, maximum likelihood, general methods of moment samt semi- och icke parametriska metoder. Kursen tillämpar linjära, icke linjära och dynamiska modeller. Betoningen ligger på linjär och icke linjär paneldata (pooled data models, fixed effects, random effects, mixed models, dynamic GMM-modeller och count data models) Kursen introducerar också metoder som Data Envelop Analysis, Stochastic Frontier Production samt matchningsansatser såsom Treatment effect.

## Kursinnehåll

- Grundläggande linjära paneldatamodeller
- Avancerade linjära paneldatamodeller
- Ickelinjära paneldatamodeller
- Countdatamodeller
- Stokastisk frontproduktionsanalys och Data Envelopment

## Kurslitteratur

A.Colin Cameron and Pravin K. Trivedi: Microeconometrics Using Stata press, Revised Edition

Badi H.Baltagi: Econometric Analysis of Panel data. Fjärde upplagan.

## Examination

- TEN1 - Examination, 7,5 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.

1. Inlämningsuppgifter
2. Uppsats
3. Skriftlig tentamen
4. Aktivt deltagande i seminariediskussioner

## 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.