



FME3543 Ekonometri 7,5 hp

Econometrics

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

Fastställande

Kursplan för FME3543 gäller från och med VT17

Betygsskala

Utbildningsnivå

Forskarnivå

Särskild behörighet

Högskolestudier om minst 180 hp, varav minst 30 högskolepoäng i matematik / statistik / kvalitativ

Undervisningsspråk

Undervisningsspråk anges i kurstillfällesinformationen i kurs- och programkatalogen.

Lärandemål

Efter avslutad kurs ska deltagarna kunna:

- Visa förmåga att hantera olika sorters data och kombinera teoretiska ansatser med datadrivna beslutsprocesser.
- Visa på en grundläggande teoretisk förståelse av statistiska egenskaper som kännetecknar linjära och icke linjära regressioner

- Visa på förmåga att skilja mellan korrelation och kausala samband
- Visa förmåga att använda lämpliga kvantitativa metoder för att analysera olika former av data.
- Visa förmåga att genomföra och på ett pedagogiskt sätt presentera kvantitativa analyser

Kursinnehåll

Detta är en kurs i praktisk tillämpning av kvantitativa analysmetoder för doktorander. Kursen förutsätter att studenterna har en grundläggande kunskap i statistik och matematik liksom användning av avancerad statistisk mjukvara. Kursen är utformad för att ge studenterna praktiska kunskaper och insikt i modern forskningsmetodik i form av linjära och icke-linjära skattningsmetoder för stora datamängder. Kursens huvudsakliga moment är följande:

- Grundläggande linjär regression
- Generalized Least Square (GLS) regressioner
- Linjära instrumentvariabelskattningar
- Grundläggande och avancerade paneldatamodeller
- Binominala och Multinomiala modeller
- Selektionsmodeller
- Modeller baserade på både normal- och icke normalfördelning.

Kurslitteratur

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

Baltagi, B. (2013) Econometric Analysis of Panel Data, Fifth edition. Wiley

Green, WH (2012) Econometric Analysis, Seventh Edition. Pearson

Examination

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.

TEN1 Tentamen, 4,0 hp, betygsskala P/F

ÖVN1 Övningar, 3,5 hp, betygsskala P/F

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.