



MET 2051 Økonometri

Studium

Diplomøkonomstudiet i finans (2. år)

Kursansvarlig

Ulf Henning Olsson

Institutt

Samfunnsøkonomi

Semester

Høst

Vekttall

2

Mål

Kursets mål er å lære studentene praktisk bruk av kraftfulle og mye brukte statistiske metoder og teknikker for analyse av data i økonomisk-administrative problemstillinger. Ved de fleste undersøkelser foretas i dag dataanalysen ved hjelp av datamaskiner og ferdiglagede programpakker. For brukeren er det imidlertid viktig å ha innsikt i den teori og de forutsetninger metodene bygger på, for å kunne utnytte dem fullt ut og unngå fallgruver. Kurset tar sikte på å gi studentene slik innsikt kombinert med øvelse i bruk av statistisk programvare (SPSS/MINITAB/MICROFIT).

Forkunnskaper

Grunnkurs i statistikk og matematikk fra bedriftsøkonomstudiet eller tilsvarende. Kjennskap til konfidensintervall og hypotesetesting er nødvendig.

Obligatorisk litteratur

Studenmund, A.H. 2001. *Using Econometrics : A Practical guide*. 4th. ed. Boston, Mass.: Addison Wesley.

Anbefalt litteratur

Gujarati, D.N. 2003. *Basic Econometrics*. 4th. ed. Boston, Mass.: McGraw-Hill.

Emneoversikt

1. Oversikt, kap. 1
2. OLS, kap. 2
3. Introduksjon, kap. 3
4. Klassiske antakelser, kap. 4
5. Hypotesetesting, kap. 5
6. Multippel regresjon, kap. 6
7. Multippel regresjon, kap. 7
8. Multikollinearitet, kap. 8
9. Serial korrelasjon, kap. 9
10. Heteroskedastisitet, kap. 10

Dataverktøy

Kurset krever bruk av dataverktøy. Anbefalt programvare i kurset er programpakken SPSS/MINITAB/MICROFIT eller tilsvarende.

Gjennomføring

Kurset foreleses over ett semester med totalt 42 kurstimer. I tillegg må studentene regne med å bruke en god del tid på øvelser og oppgaver, hovedsakelig med programvare.

Eksamen

Kurset avsluttes med innlevering av en fagoppgave som går over en uke. Oppgaven kan løses i grupper på inntil tre studenter.

Eksamenskode(r)

MET 20511 Økonometri – Fagoppgave over 1 uke, som teller 100% for å oppnå godkjent karakter i kurset MET 2051, 2 vekttall

Hjelpemidler til eksamen

Arbeidet med fagoppgaven forutsetter adgang til datamaskin og bruk av programpakken SPSS, MINITAB, MICROFIT eller lignende.

Kontinuasjon

Kontinuasjon ved neste ordinære gjennomføring av eksamen.