



GJELDER FOR STUDIEÅRET 2003/2004

MET 2351 Økonometri

Studium

Diplomøkonomstudiet i finans (2. år)

Kursansvarlig

Ulf Henning Olsson

Institutt

Samfunnsøkonomi

Semester

Se studieplan for aktuelt studium

Studiepoeng

6

Mål

Kursets mål er å gi studentene en analytisk og intuitiv forståelse av den klassiske lineære regresjonsmodellen og en elementær introduksjon til økonometri. 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.

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; OLS, kap.2
2. Introduksjon, kap. 3; Klassiske antakelser, kap. 4
3. Hypotesetesting, kap. 5
4. Multippel regresjon, kap. 6 og kap.7
5. Multikollinearitet, kap. 8
6. Serial korrelasjon, kap. 9
7. Heteroskedastisitet , kap. 10
8. Tidsrekkemodeller, kap. 12
9. Simultane ligninger , kap. 14
10. Prediksjon, kap. 15

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 36 kurstimer. I tillegg må studentene regne med å bruke en god del tid på øvelser og oppgaver, hovedsakelig med programvare.

Eksamen

Kurset avsluttes med en fire timers individuell skriftlig eksamen. Eksamen vil delvis bygge på et case som utleveres ca to uker før eksamensdato. Eksamen vil kunne inneholde spørsmål fra

hele pensum. Caset skal ikke innleveres, men medbringes som underlag for eksamen.

Eksamenskode(r)

MET 23511 Økonometri – Individuell skriftlig eksamen, som teller 100% for å oppnå godkjent karakter i kurset MET 2351, 6 studiepoeng.

Hjelpemidler til eksamen

Alle skriftlige hjelpemidler er tillatt til eksamen.

Kontinuasjon

Kontinuasjon ved neste ordinære gjennomføring av eksamen.