



GJELDER FOR STUDIEÅRET 2005/2006

MET 2351 Økonometri

Studium

Bachelorstudiet i finans (2. år), Bachelorstudiet i økonomi og ledelse (2. år), Bachelorstudiet i økonomi og ledelse (3. 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

Bøker:

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

Anbefalt litteratur

Bøker:

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 tre timers individuell "multiple choice" 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 – multiple choice 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. Eksamensformen er endret fra fire timers individuell skriftlig eksamen til tre timers individuell multiple choice. Dette gjelder også studenter som skal ta kontinuasjonseksamen.