



GJELDER FOR STUDIEÅRET 2006/2007

MET 2651 Økonometri

Studium

Bachelorstudiet 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 forståelse av den klassiske lineære regresjonsmodellen og en grunnleggende forståelse for 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/SAS/STATA/Eviews eller tilsvarende).

Forkunnskaper

Grunnkurs i statistikk og matematikk.

Obligatorisk litteratur

Bøker:

Murray, Michael P. 2005. Econometrics: A Modern Introduction. Pearson/Addison-Wesley. 380/Kap 6 - kap.13

Anbefalt litteratur

Emneoversikt

- Multippel regresjon
- Hypotesetesting
- Multikollinearitet og binære variabler
- Heteroskedastisitet
- Autoregressiv forstyrrelse
- Asymptotisk teori
- Instrument variabler

Dataverktøy

Kurset krever bruk av dataverktøy. SPSS/SAS/STATA/Eviews 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.

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 26511 - Flervalgseksamen, som teller 100% for å oppnå godkjent karakter i kurset MET

2651 Økonometri, 6 studiepoeng.

Hjelpemidler til eksamen

Alle hjelpemidler tillatt.

Kontinuasjon

Kontinuasjon ved neste ordinære gjennomføring av eksamen.