Ekonometri: Panel- och tvärsnittsdata

Fristående- och programkurs

7.5 hp

Econometrics: Analysis of Cross-Section and Panel Data Material

730A21

Gäller från:

Fastställd av
Filosofiska fakultetens kvalitetsnämnd

Fastställandedatum
2012-05-21

Huvudområde
Nationalekonomi

Utbildningsnivå
Avancerad nivå

Fördjupningsnivå
A1X

Kursen ges för
- Masterprogram i nationalekonomi

Förkunskapskrav
Genomgången Nationalekonomi grundkurser 30hp, Nationalekonomi fortsättningskurser 30hp och Nationalekonomi fördjupningskurser 30hp med minst 60hp godkända eller motsvarande, samt genomgången grundkurs i Ekonometri 7,5hp eller motsvarande. Utöver ovan krävs godkända kunskaper i svenska och engelska motsvarande grundläggande behörighet på grundnivå.

Lärandemål
Efter avslutad kurs skall den studerande på en avancerad nivå kunna:
- självständigt genomföra typiska ekonometriska studier, baserad på panel- och tvärsnittsdata, inom mikro-, makro- och finansiell ekonomi med hjälp av den för frågeställningen mest relevanta ekonometriska metoden.
- redogöra för den typ av ekonometriska problem som kan kopplas till heterogenitet, identifikation, selektiva urval och olika former av begränsningar hos datamängden liksom för lösningar på dessa problem.
- teoretiskt analysera de vanligaste problemen och dess lösningar i ekonometriska studier baserade på panel- och tvärsnittsdata.
- redogöra för val av estimationsmetoder, kriterier och tester som leder till välspecificerade ekonometriska modeller.

Kursinnehåll

Kursen behandlar typiska problemställningar inom ekonometriskt utredningsarbete och forskning. Den grundläggande linjära regressionsmodellen är starkt begränsad i sina applikationer. Därför går denna kurs vidare med syftet att deltagarna efter kursen självständigt skall kunna analysera och praktiskt genomföra avancerade ekonometriska undersökningar på den nivå som krävs av arbetsmarknaden, för en god masteruppsats, inledande forskarstudier och för att kunna läsa och orientera sig inom modern empirisk forskning.

Ett exempel på moment som tas upp är modeller för paneldata där data består av en serie observationer över tiden av samma enhet. Ett annat exempel är modeller där den beroende variabeln är censurerad eller begränsad i någon form så att den t.ex. aldrig kan vara negativ eller endast antar ett fåtal diskreta värden - i det enklaste fallet noll eller ett - för att beskriva ömsesidigt uteslutande val eller utfall. Som exempel på modeller kan nämnas Tobit-, Logit- och Probit-modeller och andra liknande modeller. I samband med dessa modeller diskuteras också ”sample selection” problem, problem som uppkommer när observationer på den beroende variabeln inte har genererats från ett slumpmässigt urval utan har genererats via någon annan process. Ett exempel på det senare är när samplet bara består av försökspersoner som frivilligt anmälde sig till att delta i experimentet, eller bara av de variabler som går att mäta som t.ex. lönerna hos kvinnor som valt att förvärvsarbeta istället för att välja någon annan sysselsättning.

Undervisnings- och arbetsformer

Kursen blandar föreläsningar, seminarier och laborationer. Det bör understrykas att kursen förutsätter att deltagarna använder kursmaterialet och övar modellering på egen hand. Den schemalagda tiden för datorlaborationer och övningar är till för att introducera en problemställning.

Examination

Kursen avslutas med en skriftlig tentamen. För godkänt betyg krävs godkänt på alla obligatoriska inlämningsuppgifter. Detaljerad information återfinns i studievägledningen.

Betygsskala

Tregradig skala, U, G, VG

Övrig information

Planering och genomförande av kurs skall utgå från kursplanens formuleringar. Den kursvärdering som skall ingå i varje kurs skall därför behandla frågan om hur kursen överensstämmer med kursplanen. Kursen bedrivs på ett sådant sätt att både mäns och kvinnors erfarenhet och kunskaper synliggörs och utvecklas.

Institution

Institutionen för ekonomisk och industriell utveckling