Dnr: Fak1 2007/10

Fakulteten för ekonomi, kommunikation och IT
Statistik

Kursplan

Beslut om inrättande av kursen
Kursplanen är fastställd av Fakultetsnämnden vid Fakulteten för ekonomi, kommunikation och IT, 2007-11-14 och gäller från vårterminen 2008 vid Karlstads universitet.

Kurskod: STGC02
Ekonometri, 7.5 hp
(Econometrics, 7.5 ECTS Credits)
Utbildningsnivå: grundnivå
Progression: C

Undervisningsspråk
Undervisningen sker på engelska om internationella studenter eller lärare finns på kursen. Annars sker undervisningen på svenska.

Behörighetskrav
Statistik 60 hp varav 15 hp ekonometri.

Huvudområde
Statistik Statistics

Kursens mål

Genom kursen skall studenten förvärva kunskaper i ekonometri med fördjupning inom tidsseriemodeller. Efter genomgången kurs förväntas studenten kunna
- använda och förstå ekonometriska metoder med fördjupning inom tidsseriemodeller,
- ARIMA- och VAR-modellering av stationära och icke stationära tidsseriedata,
- analysera tidsseriedata m.h.a spektrala metoder,
- analysera long memory -processer och icke stationära tidsseriedata m.h.a. waveletsmetoder,
- tolka resultaten av en genomförd modellanpassning och
- redovisa resultat av genomförd analys i såväl muntlig som skriftlig form.

Kursens huvudsakliga innehåll

Kursen behandlar användandet av statistiska och matematiska metoder för att analysera ekonomiska data.
Kursen behandlar följande moment:
- ekonometriska metoder och redskap som ARMA/ARIMA- och ARCH/GARCH- modeller,
- VAR-modeller, enhetsrötter och kointegration,
- analys av tidsseriedata med hjälp av spektrala metoder och waveletsmetoder.

Tillämpningar illustreras med hjälp av dator.

Kurslitteraturlista och övriga läromedel

Se separat dokument.

Examination

Examinationen sker dels genom skriftlig och muntlig redovisning av ett antal obligatoriska inlämningsuppgifter, dels genom tentamen.

Betygsgrader

Kursen bedöms enligt betygsskalan Väl godkänd (VG), Godkänd (G) eller Underkänd (U).

Kvalitetsuppföljning

Under och efter kursen sker en uppföljning av måluppfyllelse och förutsättningar för lärande i kursen. Dess främsta syfte är att bidra till förbättringar. Studenternas erfarenheter och synpunkter är ett av underlagen för granskningen, och inhämtas med hjälp av skriftlig kursvärdering och/eller kursvärderingsdiskussioner. Studenterna informeras om resultaten och eventuella beslut om åtgärder.

Kursbevis

Kursbevis erhålls på begäran av studenten.

Övrigt

Studenter som påbörjat en utbildning enligt den studieordning som började gälla 1993-07-01 skall fullfölja sina studier enligt den kursplan respektive utbildningsplan de är antagna till.
Om de vid studiernas slut, vill få ut ett kursbevis eller examensbevis enligt den nya studieordningen, som träder i kraft 2007-07-01, skall de prövas mot de kriterier som karaktäriserar denna studieordning.

Regler för utbildning på grundnivå och avancerad nivå vid Karlstads universitet, Dnr C2007/368, reglerar studenters och anställdas skyldigheter och rättigheter.

Karlstads universitet 651 88 Karlstad
Tfn 054-700 10 00 Fax 054-700 14 60
information@kau.se www.kau.se