

# Ekonometrian tilastolliset perusteet 805339A

Jussi Klemelä

Luennoin Ekonometrian kurssin alkaen 23.2.2010

Tiistaisin 12.15-13.45 ja Torstaisin 12.15-13.45

salissa M201. Harjoituksia on 2 tuntia viikossa Torstaisin 16.15-17.45 salissa M304.

Kurssin laajuus on 6 opintopistettä. Opiskelijoilta edellytetään tilastotieteen peruskurssi tai vastaavat tiedot. Ekonometrialla tarkoitetaan taloustieteissä sovellettavaa tilastotiedettä tai tilastotiedettä soveltavaa taloustiedettä. Ekonometriassa tutkitaan esimerkiksi makrotaloudellisissa ilmiöissä esiintyviä välittömiä ja dynaamisia vuorovaikutussuhteita, muuttujiin sisältyviä mittausvirheitä ja muuttujien välisiä pitkän tähtäimen tasapainoisuhteita. Kurssilla käsitellään muun muassa

1. lineaarisiin ja epälineaarisiin regressiomalleihin liittyvää mallidiagnostiikkaa,
2. suurimman uskottavuuden estimointi ja testaus (uskottavuussuhdetesti, Lagrange-kerrointesti, Hausman-testi),
3. dynaamiset regressiomallit, virheenkorjausmallit,
4. instrumenttiestimointi,
5. moniyhtälömallit,
6. yhteisintegroituvuusteoria.

Kurssin suorittaneen opiskelijan on tarkoitus kyetä soveltamaan sekä lineaarisia että epälineaarisia malleja taloudellisten muuttujien välisten vuorovaikutusten tutkimisessa, tuntea paneeliaineistojen mallittamisen perusteet ja tuntea yhteisintegroituvuusteorian käyttömahdollisuudet pitkän tähtäimen tasapainorelaatioiden tutkimisessa.

Kurssiin liittyvä kirjallisuus:

1. <http://cc.oulu.fi/~mrahiala/ekonomet.pdf>
2. A. Harvey: The Econometric Analysis of Time Series (2. painos)
3. F. Hayashi: Econometrics, Princeton University Press
4. C. Gourieroux & A. Monfort: Statistics and Econometric Models, vol. 1 ja 2, Cambridge University Press.