

دانشگاه شهید چمران اهواز
معاونت آموزشی و تحصیلات تکمیلی
طرح درس ویژه درس‌های تحصیلات تکمیلی دانشگاه

نام و نام خانوادگی استاد: سید امین منصوری	مرتبه علمی: استادیار	آدرس ایمیل: sa.mansouri81@gmail.com
دانشکده: اقتصاد و علوم اجتماعی	گروه: اقتصاد	نیمسال تحصیلی: ۹۸-۹۹
دوره تحصیلی: ارشد	نام درس: اقتصاد سنجی	تعداد واحد: ۲
<p>جایگاه درس در برنامهٔ درسی دوره: به منظور آماده سازی پایان نامه کارشناسی ارشد این درس می تواند اخذ شود</p>		
<p>هدف کلی: هدف اصلی در این درس آشنایی دانشجویان با مبانی نظری و مدل های درس اقتصادسنجی است</p>		
<p>اهداف یادگیری: انتظار این است که دانشجویان بعد از این درس به موارد زیر تسلط کافی داشته باشند:</p> <ol style="list-style-type: none"> ۱- آشنایی با مدل های تک متغیره و چند متغیره ۲- آشنایی با مشکلات مربوط به مدل های حداقل مربعات ۳- آشنایی با مدل های همزمان و روش های برآورد ۴- آشنایی با مدل های سری زمانی 		
<p>رفتار ورودی: دانشجویان برای ورود به دوره می بایست به مبانی نظری درس اقتصاد خرد، اقتصاد کلان و برخی از نرم افزارهای رشته تسلط کافی داشته باشند.</p>		
<p>مواد و امکانات آموزشی: کتاب، جزوه، لپتاپ و نرم افزارهای اقتصادی</p>		
<p>روش تدریس: روش تدریس درس اقتصاد سنجی از نوع تعاملی و اکتشافی است. به طوری که دانشجویان می بایست به صورت مستمر در کلاس درس حضور فعال داشته و در صورت ضرورت در مباحث کلاسی مشارکت داشته باشند و در صورت نیاز به بررسی موضوع و فعالیت های گفته شده، پیگیری و اکتشاف موضوعات پرداخته شود.</p>		
<p>وظایف دانشجو:</p> <ol style="list-style-type: none"> ۱- حضور فعال در کلاس های درس ۲- بررسی و مطالعه ی موضوعات برای هر جلسه ی آتی ۳- مشارکت در مباحث کلاسی و در صورت چاشنی شدن موضوع، بررسی موضوع و طرح برای جلسه ی آتی ۴- ارائه ی مطالب مشخص شده برای هر دانشجو ۵- پیگیری و مطالعه و یادگیری اولیه ی مدل های اقتصاد سنجی 		
<p>شیوه آزمون و ارزیابی:</p> <ul style="list-style-type: none"> - امتحان پایان ترم ۵۰ درصد - ارائه های کلاسی ۳۰ درصد - مشارکت در تحلیل ها و پیگیری مطالب گفته شده در جلسات ۲۰ درصد 		

منابع درس:

اقتصاد سنجی گجراتی- جلد اول و دوم- ترجمه ابریشمی
اقتصاد سنجی کاربردی آستریو- ترجمه ی حسین محمدی
جزوه برداری توصیه می شود

سرفصل درس:

هفته یکم	مباحث کلی و اولیه قواعد آماری مورد نیاز اقتصاد سنجی، توضیحات اولیه در مورد اقتصاد سنجی، تفاوت اقتصاد سنجی با اقتصاد ریاضی، انواع آمارو اطلاعات، آمار نمونه و آمار جامعه، متغیرهای مستقل و وابسته، انواع مدل رگرسیون، مفهوم خطی بودن
هفته دوم	روش حداقل مربعات معمولی - مروری بر اقتصاد سنجی دوره ی کارشناسی
هفته سوم	روش حداقل مربعات معمولی - مروری بر اقتصاد سنجی دوره ی کارشناسی
هفته چهارم	روش حداقل مربعات معمولی - مروری بر اقتصاد سنجی دوره ی کارشناسی
هفته پنجم	روش حداقل مربعات معمولی - مروری بر اقتصاد سنجی دوره ی کارشناسی
هفته ششم	روش حداقل مربعات معمولی - مروری بر اقتصاد سنجی دوره ی کارشناسی
هفته هفتم	روش حداکثر درستنمای

تابع درست‌نمایی، روش حداکثر درست‌نمایی در رگرسیون ساده دو متغیره، روش حداکثر درست‌نمایی در رگرسیون چند متغیر، آزمون نسبت درست‌نمایی، آزمون ضریب لاگرانژ، آزمون والد.

هفته هشتم

مشکلات داده ها

- همخطی، مفهوم همخطی، تبعات همخطی، شناسایی همخطی، راه های کاهش همخطی، خطای اندازه گیری، مشاهدات مفقوده

هفته نهم

مشکلات تصریح

- فرم تبعی نادرست، حذف متغیرهای مهم از مدل، ورود متغیرهای نامربوط در مدل، نقض فرض همسانی واریانس و تبعات آن

هفته دهم

ماهیت ناهمسانی واریانس و دلایل آن

- تخمین ضرایب با وجود ناهمسانی واریانس و تبعات آن، آزمونهای تشخیص ناهمسانی واریانس، برآوردگر روش حداقل مربعات وزنی و رفع ناهمسانی واریانس، برتری روش حداقل مربعات وزنی در صورت وجود ناهمسانی واریانس

هفته یازدهم

نقض فرض استقلال جملات اختلال

- ماهیت خودهمبستگی و دلایل آن، تخمین ضرایب تحت شرایط خودهمبستگی، تشخیص خودهمبستگی، برآوردگر حداقل مربعات تعمیم یافته، خودهمبستگی و مدل های پویا.

هفته دوازدهم

مدل متغیر مجازی (موهومی)

- ماهیت متغیرهای مجازی، رگرسیون بر روی یک متغیر کیفی دو حالتی، رگرسیون بر روی یک متغیر کیفی با بیش از دو حالت (گروه)، رگرسیون بر روی یک متغیر کمی و یک متغیر کیفی دو حالتی، رگرسیون بر روی یک متغیر کمی و یک متغیر کیفی با بیش از دو حالت (گروه)، رگرسیون بر روی یک متغیر کمی و دو متغیر کیفی، تحلیل شکست ساختاری با آزمون چاو، کاربرد متغیر مجازی در تحلیل‌های فصلی، کاربرد متغیر مجازی در رگرسیونهای قطعه ای

هفته سیزدهم

سیستم معادلات همزمان

- معرفی فرمهای ساختاری و فرم خلاصه شده، مسئله تشخیص، شرط لازم، شرط کافی، تورش برآوردگر روش

حداقل مربعات خطی، تخمین سیستم معادلات همزمان، روشهای تک معادلهای برآورد، روش حداقل مربعات غیرمستقیم، روش حداقل مربعات دومرحله ای، روشهای سیستمی، روش حداقل مربعات سه مرحله ای.

هفته چهاردهم

مدل های اقتصاد سنجی پویا

- مدل های با وقفه ی توزیع گسترده، تبدیل کویک، تبدیل آلمون، مدل های خودبازگشت

هفته پانزدهم

اقتصاد سنجی سری های زمانی

- آزمون مانایی و ریشه واحد، مدل های ARIMA، مدل های ARCH

هفته شانزدهم

اقتصاد سنجی سری های زمانی

- مدل های VAR و مسئله ی همجعی و مدل های تصحیح خطا