

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

نام و نام خانوادگی استاد: سید امین منصوری	مرتبۀ علمی: استادیار	آدرس ایمیل: sa.mansouri81@gmail.com
دانشکده: اقتصاد و علوم اجتماعی	گروه: اقتصاد	نیمسال تحصیلی: ۹۸-۹۹
دوره تحصیلی: کارشناسی ارشد	نام درس: اقتصاد سنجی کاربردی	تعداد واحد: ۳
<p><b>جایگاه درس در برنامه درسی دوره:</b> دانشجویان ترم دوم به بعد می توانند به منظور آماده سازی پایان نامه این درس را اخذ نمایند.</p>		
<p><b>هدف کلی:</b> هدف اصلی در این درس آشنایی دانشجویان با روش تحقیق علمی، آشنایی با مدل سازی اقتصاد سنجی و تصریح مدل های اقتصادی، آشنایی با بکارگیری انواع آمار و اطلاعات در مدل های سنجی به صورت کاربردی و ارائه ی پیش بینی جهت اخذ سیاست های اقتصادی است.</p>		
<p><b>اهداف یادگیری:</b> انتظار این است که دانشجویان بعد از این درس به موارد زیر تسلط کافی پیدا کنند:</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>۱- شناخت روش شناسی تحقیق شامل بیان مسئله ی تحقیق، اهداف تحقیق، فرضیه های تحقیق، ضرورت تحقیق</li> <li>۲- بررسی مبانی نظری و جستجوی پیشینه ی مطالعات و انتخاب موضوع تحقیق</li> <li>۳- شناخت مدل سازی: آشنایی با انواع توابع و مدل های تحقیق و چگونگی تصریح مدل</li> <li>۴- بررسی آمار و اطلاعات تحقیق: آشنایی با نوع آمار و اطلاعات، منابع اطلاعاتی، نحوه ی استخراج و جمع آوری</li> <li>۵- انتخاب نوع مدل تخمین سنجی: شامل مدل های مقطع ی، مدل های سری زمانی و همجمله ی، مدل های تابلویی و مدل های معادلات همزمان، خاص مربوط به تحقیق</li> <li>۶- شناخت نرم افزاری: شامل ایوبوز، ماکروفیت، استاتا، متلب و نرم افزارهای تخصصی مربوط به موضوع.</li> </ol>		
<p><b>رفتار ورودی:</b> دانشجویان برای ورود به دوره می بایست به مبانی نظری درس اقتصاد سنجی عمومی شامل مشکلات داده ها، نقص فروش کلاسیک، روش حداکثر درست نم ای، سیستم معادلات همزمان، نقش مدل متغیر مجازی (موهومی)، مدل انتخاب دوتایی و مدل های وابسته محدود، اقتصادسنجی سری های زمانی و روش داده های تابلویی آشنایی کافی داشته باشند.</p>		
<p><b>مواد و امکانات آموزشی:</b> کتاب، جزوه، لپتاپ و نرم افزارهای اقتصادی شامل ایوبوز، استاتا، متلب و ...</p>		
<p><b>روش تدریس:</b> روش تدریس درس اقتصاد سنجی کاربردی 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 به پرسش های کلاسی پاسخ داده شود و در صورت نیاز به حل تمرین ها و فعالیت های گفته شده پرداخته شود و چالش های گفته شده را مورد بررسی و کاوش قرار دهد.</p>		
<p><b>وظایف دانشجو:</b></p> <ol style="list-style-type: none"> <li>۱- تسلط کافی بر شناخت روش شناسی تحقیق با ضریب دو</li> <li>۲- تسلط کافی بر بررسی مبانی نظری و جستجوی پیشینه ی مطالعات و انتخاب موضوع تحقیق با ضریب دو</li> <li>۳- تسلط بر مدل سازی شامل آشنایی دانشجو با انواع توابع و مدل های تحقیق و چگونگی تصریح مدل با ضریب سه</li> <li>۴- تسلط بر حداقل یک موضوع که از آمار و اطلاعات کیفی استفاده می شود و یک موضوع که از آمار و اطلاعات کمی استفاده می شود با ضریب سه</li> <li>۵- تسلط بر حداقل سه روش از روش های تخمین از بین مدل های اقتصاد سنجی با ضریب چهار</li> <li>۶- شناخت کافی بر حداقل یک نرم افزار اقتصادی با ضریب چهار</li> </ol>		

### شیوه آزمون و ارزیابی:

- امتحان مربوطه در هر کدام از این بخش های شش گانه ی توضیح داده شده در بالا، پس از اتمام مبحث مربوط گرفته خواهد شد.
- امتحان نهایی به دو صورت عملی شامل امتحان در کارگاه اقتصاد سنجی کاربردی و تحویل تحقیق کاربردی است.
- نمره نهایی شامل متوسط نمرات در طول ترم از بخش های ششگانه، امتحان نهایی و تحویل تحقیق انجام شده است.

### منابع درس:

- روش تحقیق علمی - جزوه ی درسی سید عباس ابراهیمی
- اقتصاد سنجی گجراتی جلد دوم مترجم: ابریشمی
- اقتصاد سنجی کاربردی سری های زمانی - نویسندگان: هلموت لوتکه پل و ممارکوس کرتزیش - مترجم: شیرین بخش و مقدس بیات
- اقتصاد سنجی داده های تابلویی: روش ها و مفاهیم - مولفان منصوری و آرمن
- مقالات به روز از پایگاه های اطلاعاتی

### سرفصل درس:

هفته یکم (۹۸۶/۲۹ تا ۹۸۶/۲۳)	۱- روش تحقیق علمی
هفته دوم (۹۸۷/۵ تا ۹۸۶/۳۰)	۲- مشکلات داده ها همخطی، مفهوم همخطی، تبعات همخطی، شناسایی همخطی، راه های کاهش همخطی، خطای اندازه گیری، مشاهدات مفقوده،
هفته سوم (۹۸۷/۱۲ تا ۹۸۷/۶)	۳- 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 چهارم (۹۸۷/۱۳ تا ۹۸۷/۱۹)	۴- 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 پنجم  
(۹۸۷۶/۲۰ تا ۹۸۷۷/۲۶)

۵- 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 ششم  
(۹۸۷۷/۲۷ تا ۹۸۷۸/۳)

۶- 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 هفتم  
(۹۸۷۸/۴ تا ۹۸۷۹/۱۰)

۷- مدل متغیر مجازی (موهومی)

ماهیت متغیرهای مجازی، رگرسیون بر روی یک متغیر کیفی دو حالت، رگرسیون بر روی یک متغیر کیفی با بیش از دو حالت (گروه)، رگرسیون بر روی یک متغیر کمی و یک متغیر کیفی دو حالت، 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 هشتم  
(۹۸۷۹/۱۱ تا ۹۸۸۰/۱۷)

۸- مدل انتخاب دوتایی و مدلهای وابسته محدود

مدل احتمال خطی، مدل لاجیت، مدل پروبیت، معیارهای خوبی برازش

هفته نهم  
(۹۸۸۰/۱۸ تا ۹۸۸۱/۲۴)

۹- مروری اجمالی بر اقتصادسنجی سری های زمانی

مفهوم سری زمانی، سرهای زمانی مانا و نامانا، فرایندهای مانای تک متغیره خودرگرسیو و میانگین متحرک، فرایند ARMA، مدل سازی ARMA: روش باکس جنکینز، همجمعی، انواع روش های همجمعی

هفته دهم  
(۹۷/۹/۱ تا ۹۷/۹/۲۵)

۱۰- معرفی روش داده های تابلویی

مفهوم پانل دیتا، مزیت های پانل، معرفی مدل های یک طرفه، مدل ECM، اثرات ثابت، اثرات تصادفی، نحوه ی تشخیص و ...

هفته یازدهم  
(۹۷/۹/۸ تا ۹۷/۹/۲۲)

۱۱- مدل سازی نرم افزاری

هفته دوازدهم  
(۹۷/۹/۱۵ تا ۹۷/۹/۲۹)

ارائه یک مطالعه کاربردی از اقتصاد ایران: تمرین مطالب پیشگفته

هفته سیزدهم  
(۹۷/۹/۲۲ تا ۹۷/۹/۲۶)

ارائه یک مطالعه کاربردی از اقتصاد ایران: تمرین مطالب پیشگفته

هفته چهاردهم  
(۹۷/۹/۲۹ تا ۹۷/۹/۳۳)

ارائه یک مطالعه کاربردی از اقتصاد ایران: تمرین مطالب پیشگفته

هفته پانزدهم  
(۹۷/۱۰/۶ تا ۹۷/۹/۳۰)

ارائه یک مطالعه کاربردی از اقتصاد ایران: تمرین مطالب پیشگفته

هفته شانزدهم  
(۹۷/۱۰/۱۳ تا ۹۷/۱۰/۱۷)

ارائه یک مطالعه کاربردی از اقتصاد ایران: تمرین مطالب پیشگفته