

## طرح درس اقتصاد سنجی ۲

-کتاب:

- اقتصاد سنجی گجراتی - جلد دوم - ترجمه ابریشمی
- اقتصاد سنجی درخشان جلد دوم
- جزوه برداری توصیه می شود

موارد امتحان:

- امتحان میان ترم ۵ نمره (بخش اول) - ۱۹ یا ۲۱ آبان ماه شامل موارد نظری و نرم افزاری
- پایان ترم ۱۲ نمره (بخش دوم)
- مشارکت کلاسی شامل (بخش سوم):
- حل تمرین ها (هر مورد ۰/۲۵ تا ۲ نمره)
- پاسخ به پرسش های کلاسی (هر مورد ۰/۲۵ تا ۲ نمره)
- تسلط نرم افزاری و انجام یک تحقیق با کاربرد نرم افزاری آن (۳ نمره) **\*\*اجباری\*\***
- حضور و غیاب در کلاس ۲ نمره مازاد (به ازای هر غیبت ۰/۵ نمره کسر می شود)

-نحوه ی ارتباط:

کانال تلگرام: @samansouri  
ایمیل: sa.mansouri81@gmail.com  
دفتر: دانشکده اقتصاد - طبقه دوم

مواردی که برای آن ها منفی در نظر گرفته می شود:

- تأخیرهای مکرر در حضور در کلاس
- بازی با موبایل
- ورود و خروج های مکرر و یا با فاصله ی زمانی طولانی
- بی احترامی به کلاس و ایجاد سر و صداهای بی مورد
- صحبت کردن با همکلاسی در زمان صحبت استاد و یا دانشجویان
- حضور فیزیکی بدون توجه به درس

سر فصل دروس:

۱- مشکلات داده ها

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

۲- مشکلات تصریح

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

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

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.

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.

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.

۷- 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

ارائه یک مطالعه کاربردی از اقتصاد ایران: تمرین مطالب پیشگفته