

فرآیند میانگین متحرک خودهمبسته انباشته (ARMA, ARIMA)

☀ سری های زمانی نامانا و ریشه واحد

آزمونهای مانایی

مفاهیم و کاربردهای همجمعی

آزمون انگل - گرنجر

آزمونهای همجمعی و الگوهای تصحیح خطا

الگوی ARDL با آزمون بنرجی و همکاران

الگوی ARDL با آزمون کرانه ها

الگوهای VAR، VECM و رهیافت یوهانسن

مطالعه توابع واکنش آنی

مطالعه تجزیه واریانس

پیش بینی سری های زمانی چند متغیره

کارگاه تجربی جهت مرور مطالب

☀ بررسی نقض فرض کلاسیک و آزمونهای مرتبط

مبانی، روشهای تشخیص و رفع ناهمسانی واریانس

مبانی، نحوه تشخیص و رفع خود همبستگی

آزمون نرمال بودن

آزمون تشخیص رمزی (Ramsey)

مبانی، نحوه تشخیص و رفع هم خطی

آزمون ثبات ضرایب

آزمون متغیرهای حذف شده

آزمون والد (محدودیتها)

☀ اقتصادسنجی متغیرهای وابسته محدود و کیفی

مرور مبانی

تخمین مدل Logit و تفسیر نتایج

تخمین مدل Probit و تفسیر نتایج

تخمین مدل لاجیت چندگانه (Multinomial Logit)

(Model)

تخمین مدل Tobit

کارگاه تجربی جهت مرور مطالب

☀ سری های زمانی مانا

فرآیند خودرگرسیو (AR)

فرآیند میانگین متحرک (MA)

طول دوره: ۱۲ ساعت

ظرفیت: حداقل ۱۰ نفر و حداکثر ۱۵ نفر

پیشنیاز: اقتصاد سنجی ۲ و دوره آموزشی مقدماتی

«اقتصادسنجی ۱» با نرم افزار ایویوز

مخاطب: آزاد