



اقتصادسنجی پیشرفته کاربردی

هدف از ارائه این درس آشنایی دانشجویان مقطع دکتری اقتصاد کشاورزی با مدل سازی صحیح در اقتصادسنجی است و برآورد مدل های تصریح شده است.

مدرس: ابراهیم مرادی

تعداد واحددرسی و ساعات تدریس:

این درس در قالب سه واحد درسی ارائه می شود و کلاسها در دو جلسه ۱/۵ ساعته در هفته برگزار خواهد شد.

پیش نیاز درس:

دانشجویان لازم است بر مفاهیم پایه ای درس اقتصادسنجی تسلط کافی داشته باشند.

نرم افزار مورد استفاده: NLOGIT 5.0, JMULTI, R, STATA, Limdep v10.0

موضوع	جلسه درس
مروری بر سری های زمانی	۱
فرایند خود رگرسیون - میانگین متحرک (ARMA)	۲
مدل های فضا - حالت (پیش بینی به روش فیلتر کالمن)	۳
بررسی مقالات و تمرین برآورد مدل ها با نرم افزارهای مربوطه	۴
آزمونهای همجمعی بدون لحاظ شکستهای ساختاری	۵
آزمونهای همجمعی با لحاظ شکستهای ساختاری	۶
آزمونهای ریشه واحد و همجمعی با نرم افزارهای اقتصادسنجی و بررسی مقالات	۷
مدل های خود رگرسیون برداری (VAR)	۸
روشهای محاسبه ضرایب فرم ساختاری SVAR	۹
مدل تصحیح خطای برداری (VECM)	۱۰
هم انباشتگی و تصحیح خطای برداری (VECM)	۱۱
مدل خود رگرسیون با وقفه های گسترده (ARDL)	۱۳
الگوی غیر خطی (نامتقارن) خود رگرسیون با وقفه های گسترده (NARDL)	۱۴
مدل های خود رگرسیون برداری با داده های تابلویی (pvar)	۱۵

آموزش برآورد انواع مدل‌ها با نرم افزارهای اقتصادسنجی	۱۶
مدل‌های تغییرپذیر و نااطمینانی	۱۷
مدل واریانس شرطی خودرگرسیون،	۱۸
مدل واریانس شرطی خودرگرسیون تعمیم یافته (GARCH)، سایر مدل‌ها	۱۹
مدل‌های مرزی تصادفی	۲۰
تکنیک JLMs در تجزیه جمله خطا	۲۱
مدل‌های هزینه مرزی با داده‌های تابلویی (panel data)	۲۲
مدل‌های مختلف تصریح و برآورد تابع مرزی با داده‌های تابلویی	۲۳
معادلات همزمان	۲۴
برآورد رگرسیون با داده‌های تابلویی (۱)	۲۵
برآورد رگرسیون با داده‌های تابلویی (۲)	۲۶
اقتصادسنجی فضایی (۱)	۲۷
اقتصادسنجی فضایی (۲)	۲۸
رگرسیون غیرخطی	۲۹
مدلهای رگرسیون حد آستانه	۳۰
مدلهای لجیت و پروبیت و رگرسیون سانسور شده	۳۱
برآورد مدل‌های مختلف با نرم افزار R	۳۲