



به نام خدا

دانشگاه سیستان و بلوچستان – دانشکده مدیریت و اقتصاد

استاد درس: دکتر مرضیه اسفندیاری

فرم طرح درس – اقتصاد سنجی پیشرفته

مقطع: دکتری رشته: علوم اقتصادی تعداد و نوع واحد: ۲ (نظری) نوع درس: اصلی

اهداف کلی درس: آشنایی با تجزیه تحلیل آمارهای اقتصادی، تخمین روابط بین متغیرها، آزمون های آماری، پیش بینی

منبع درس: اقتصاد سنجی دکتر غلامرضا کشاورز حداد  
مقالات مختلف

شیوه ارزیابی: تکالیف کلاسی و آزمون نهایی

موضوعات مورد بحث در هر جلسه	
مقدمه فروض کلاسیک	هفته اول
نقض فروض کلاسیک	هفته دوم
متدولوژی اقتصاد سنجی	هفته سوم
اقتصاد سنجی بیزین ۱	هفته چهارم
اقتصاد سنجی بیزین ۲	هفته پنجم

مطالبی در خصوص مانایی متغیرها	هفته ششم
تحلیل سری های زمانی نامانا	هفته هفتم
آزمون های ریشه واحد سری های زمانی و تحلیل هم انباشتگی	هفته هشتم
آزمون های داده های ترکیبی	هفته نهم
برآوردگر گشتاورهای تعمیم یافته (GMM)	هفته دهم
آزمون های مرتبط با تکنیک گشتاورهای تعمیم یافته	هفته یازدهم
ارائه گزارش های برآورد با استفاده از نرم افزار استتا	هفته دوازدهم
الگوسازی نوسانات (معرفی ARCH, GARCH) ( معرفی ARCH , GARCH چند متغیره)	هفته سیزدهم
کالمن فیلتر و مارکوف سوئیچینگ مدل	هفته چهاردهم
مدل های استانه ای	هفته پانزدهم
ارائه گزارش برآورد مدل ها	هفته شانزدهم