



اقتصادسنجی

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

مدرس: ابراهیم مرادی

تعداد واحد درسی 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: STATA, Eviews

موضوع	جلسه درس
مفاهیم پایه ای اقتصادسنجی: تعریف، مدل سازی	۱
برآورد به روش ols	۲
ادامه برآورد به روش ols	۳
برآورد به روش MLE	۴
فرضیات مدل کلاسیک	۵
همخطی	۶
واریانس ناهمسانی	۷
خودهمبستگی	۸
خطای تصریح مدل ۱	۹
خطای تصریح مدل ۲	۱۰
کارگاه آموزشی اقتصادسنجی با نرم افزار STATA, Eviews	۱۱
کارگاه آموزشی اقتصادسنجی با نرم افزار STATA, Eviews	۱۲
مروری بر سری های زمانی	۱۳
فرایند خود رگرسیون - میانگین متحرک (ARMA)	۱۴

۱۵	بررسی مقالات و تمرین برآورد مدل‌ها با نرم‌افزارهای مربوطه
۱۶	آزمونهای همجمعی بدون لحاظ شکستهای ساختاری
۱۷	آزمونهای همجمعی با لحاظ شکستهای ساختاری
۱۸	آزمونهای ریشه واحد و همجمعی با نرم‌افزارهای اقتصادسنجی و بررسی مقالات
۱۹	مدل‌های خود رگرسیون برداری (VAR)
۲۰	روشهای محاسبه ضرایب فرم ساختاری SVAR
۲۱	مدل تصحیح خطای برداری (VECM)
۲۲	هم‌انباشتگی و تصحیح خطای برداری (VECM)
۲۳	مدل خود رگرسیون با وقفه‌های گسترده (ARDL)
۲۳	معادلات همزمان ۱
۲۴	معادلات همزمان ۲
۲۵	برآورد رگرسیون با داده‌های تابلویی (۱)
۲۶	برآورد رگرسیون با داده‌های تابلویی (۲)
۲۷	مدلهای لجیت و پروبیت و رگرسیون سانسور شده
۲۸	مدلهای لجیت و پروبیت و رگرسیون سانسور شده (۲)
۲۹	کارگاه آموزشی اقتصادسنجی با نرم افزار Eviews, STATA
۳۰	کارگاه آموزشی اقتصادسنجی با نرم افزار Eviews, STATA
۳۱	کارگاه آموزشی اقتصادسنجی با نرم افزار Eviews, STATA
۳۲	ارائه پروژه توسط دانشجویان