

بنام خدا

دانشگاه سیستان و بلوچستان - دانشکده مدیریت و اقتصاد

فرم طرح درس - اقتصاد سنجی

مقطع: کارشناسی ارشد رشته: علوم اقتصادی تعداد واحد: ۳ مدرس: مرضیه اسفندیاری

منبع اصلی درس: ۱- اقتصاد سنجی (جلد ۱ و ۲) تألیف گجراتی - مترجم: دکتر ابریشمی

منابع کمکی: ۲- اقتصاد سنجی تألیف دکتر علی سوری

۳- اقتصاد سنجی مالی تألیف: دکتر غلامرضا کشاورز حداد

منابع مورد استفاده	هدف	زمانبندی	موضوعات مورد بحث در هر جلسه
فصل ۱-۸ از منبع درسی ۱	مروری بر اقتصاد سنجی کلاسیک	هفته اول	مقدمه ای بر اقتصاد سنجی و کاربرد آن در علم اقتصاد
		جلسه اول	
		جلسه دوم	تحلیل رگرسیون - تحلیل همبستگی و تحلیل علیت - تابع رگرسیون نمونه و جامعه
		هفته دوم	روش حداقل مربعات معمولی
		جلسه اول	
		جلسه دوم	خصوصیات تخمین زنده های OLS تحت فرض نرمال
		هفته سوم	تخمین نقطه ای و تخمین فاصله ای - توزیع های F, t, Z, N
		جلسه اول	
		جلسه دوم	رگرسیون دو متغیره و چند متغیره
		هفته چهارم	معیار خوبی برازش و تحلیل نتایج رگرسیون
		جلسه اول	
		جلسه دوم	رگرسیون K متغیره
		هفته پنجم	آموزش نرم افزار Eviews
		جلسه اول	
		جلسه دوم	ارائه نتایج برآورد یک رگرسیون خطی توسط دانشجویان در کلاس و تحلیل یافته ها
		هفته ششم	روش ماتریسی مدل رگرسیون خطی
		جلسه اول	
		جلسه دوم	آزمون ۱

نقض فروض کلاسیک	هفته هفتم	جلسه اول	روش حداکثر درستنمایی -
		جلسه دوم	نقض فروض کلاسیک - همخطی: ماهیت، تخمین OLS، نتایج
	هفته هشتم	جلسه اول	ناهمسانی واریانس، ماهیت، نتایج برآورد OLS، کشف ناهمسانی واریانس، رفع ناهمسانی واریانس
		جلسه دوم	خودهمبستگی، ماهیت، نتایج برآورد OLS، کشف ناهمسانی واریانس، رفع ناهمسانی واریانس
	هفته نهم	جلسه اول	آزمون های کشف خطای تصریح
		جلسه دوم	ارائه نتایج برآورد مدل و بررسی همخطی، ناهمسانی واریانس، خطای تصریح، خودهمبستگی
(منبع درسی ۱)	هفته دهم	جلسه اول	مدل های معادلات همزمان - ماهیت، تورش
		جلسه دوم	مدل های معادلات همزمان - تشخیص
	هفته یازدهم	جلسه اول	مدل های معادلات همزمان - تخمین
		جلسه دوم	ارائه یافته های دانشجویان در برآورد سیستم معادلات همزمان و بررسی نتایج
سری زمانی و پیش بینی	هفته دوازدهم	جلسه اول	سری های زمانی - ریشه واحد و آزمون تشخیص
		جلسه دوم	همبستگی
	هفته سیزدهم	جلسه اول	سری زمانی - روش های پیش بینی اقتصادی
		جلسه دوم	مدلسازی AR, MA, ARIMA
منبع درسی ۱ و ۲ و ۳	هفته چهاردهم	جلسه اول	ارائه یافته های دانشجویان در موضوعات سری زمانی
		جلسه دوم	تلفیق سری زمانی و داده های مقطعی: کاربرد و مزایا - روش های برآورد داده های تابلویی
	هفته پانزدهم	جلسه اول	آزمون های تشخیص روش برآورد - ارائه یافته های دانشجویان در برآورد با داده - های تابلویی و بررسی نتایج
		جلسه دوم	لاجیت - پروبیت - GMM

اقتصاد سنجی

تعداد واحد : ۳

نوع واحد : نظری

پیشنیاز : ندارد

هدف: آشنا ساختن دانشجویان با روشهای بر آورد و آزمون الگوهای اقتصادی

سرفصل دروس (۴۸ ساعت)

۱- الگوهای یک معادله :

مقدمه ای بر الگوهای رگرسیون ، الگوی رگرسیون دو متغیره ، الگوی رگرسیون چند متغیره ، همبستگی پیایی و واریانس ناهمسانی ، پیش بینی با استفاده از الگوی رگرسیون یک معادله ای

۲- الگوهای معادلات همزمان :

مسئله شناسائی ، برآورد پارامترها با استفاده از الگوهای مختلف ، کاربرد الگوهای معادلات همزمان .

۳- الگوهای سریهای زمانی

ویژگیهای سریهای زمانی استوکاستیک ، مدلهای خطی سریهای زمانی ، برآورد الگوهای سریهای زمانی ، پیش بینی با استفاده از الگوهای سریهای زمانی .

