به نام خدا

طرح درس (Course Plan)

جدول برنامه زمانی و موضوعات مورد نظر برای تدریس و ارزیابی:

گروه آموزشی: مهندسی اقتصاد کشاورزی

مقطع تدریس: **کارشناسی ارشد** نام درس: **اقتصادسنجی تکمیلی** کد درس:

تعداد واحد: **۳** واحد نظری **۳** واحد عملی • نوع آکادمیک درس: جبرانی ☐ پایه ☐ اصلی ☐ تخصصی ■ عمومی ☐

ساعات تدریس کلاس در هفته: **۳** ساعت

هدف کلی درس

افزایش توانمندی‌های دانشجویان در فرموله کردن و توسعه الگوهای اقتصادسنجی، ارزیابی نتایج الگوها و افزایش توان دانشجویان در انجام تحقیقات کاربردی با بکارگیری دانش اقتصادسنجی

رئوس مطالب

مدل اقتصادی و مدل اقتصادسنجی، ابزارهای تجزیه و تحلیل اطلاعات و آمار، الگوهای آماری خطی کلی و آزمون فرضیه (تصریح الگو، برآورد و خصوصیات مطلوب برآوردکننده)، الگوی آماری با جمله خطای نرمال(Normal General statistical Model) (تصریح الگو، روش برآورد حداکثر درستنمایی(MLE)، آزمونهای LR، Wald و LM)، موارد نقض فروض کلاسیک در مورد جمله خطا (علل، پیامدها، نحوه تشخیص، نحوه درمان و برآوردکننده مناسب)، تصریح درست الگوهای اقتصادسنجی (Model Specification)،پیامدهای تصریح نادرست، معیارهای تصریح درست، آزمونهای انتخاب درست فرمهای تابعی(Functional Form)، متغیرهای موهومی و کاربرد آن‌ها، تغییرات ساختاری و ثبات پارامترها (نحوه تشخیص و رفع آن)، متغیرهای استوکاستیک (Stochastic) و متغیرهای ابزاری (نحوه تصریح، برآورد و آزمون)، سیستم معادلات (سیستم خطی و غیرخطی، نحوه برآورد، آزمون و کاربرد آن‌ها)، الگوهای لاجیت، پروبیت و توبیت (نحوه تصریح، برآورد و کاربرد آن‌ها)، رفتار سری‌های زمانی، پایایی، آزمون‌های مربوطه، تمرین‌های کلاسی و انجام یک پروژه عملی.

***سنجش و ارزشیابی دانشجو:**

روش	نمره	زمان	شیوه
ارزشیابی مستمر و آزمون میان‌ترم	۷	در طول ترم و جلسه چهاردهم به بعد	سوال چند گزینه‌ای و تشریحی
آزمون پایان ترم	۱۳	پایان ترم	سوال چند گزینه‌ای و تشریحی
فعالیت ها و مشارکت در مباحث	۲-۰	در طول ترم	

منابع درس:

Econometric Analysis, Green., Macmillan.

Introduction to the theory and practice of Econometrics, Judge et al., Wiley.

مبانی اقتصادسنجی، جلد۲، گجراتی.، انتشارات دانشگاه تهران،

اقتصادسنجی پیشرفته(جلد ۲)، علی سوری.، نشر فرهنگ شناسی

اقتصادسنجی داده‌های خرد و ارزیابی سیاست، غلامرضا کشاورز حداد.، نشر نی

کتاب اقتصادسنجی خرد کاربردی متغیرهای وابسته محدودشده بااستفاده STATA

فصلنامه مدلسازی اقتصادسنجی

به نام خدا

طرح درس (Course Plan)

جلسه	موضوع
اول	مدل اقتصادی و مدل اقتصادسنجی، ابزارهای تجزیه و تحلیل اطلاعات و آمار
دوم	الگوهای آماری خطی کلی و آزمون فرضیه (تصریح الگو، برآورد و خصوصیات مطلوب برآوردکننده)
سوم	الگوی آماری با جمله خطای نرمال(Normal General statistical Model) (تصریح الگو، روش برآورد حداکثر درستنمایی(MLE)، آزمونهای LR، Wald و LM)
چهارم	ادامه‌ی الگوی آماری با جمله خطای نرمال...
پنجم	ادامه‌ی الگوی آماری با جمله خطای نرمال...
ششم	موارد نقض فروض کلاسیک در مورد جمله خطا (علل، پیامدها، نحوه تشخیص، نحوه درمان و برآوردکننده مناسب)،
هفتم	ادامه موارد نقض ...
هشتم	کار با نرم‌افزار در راستای انجام پروژه عملی
نهم	ادامه کار با نرم‌افزار....
دهم	تصریح درست الگوهای اقتصادسنجی (Model Specification)،پیامدهای تصریح نادرست، معیارهای تصریح درست، آزمونهای انتخاب درست فرمهای تابعی(Functional Form)
یازدهم	ادامه تصریح درست ....
دوازدهم	ادامه تصریح درست ....
سیزدهم	متغیرهای موهومی و کاربرد آن‌ها،
چهاردهم	ادامه متغیرهای موهومی و کاربرد آن‌ها،
پانزدهم	تغییرات ساختاری و ثبات پارامترها (نحوه تشخیص و رفع آن)
شانزدهم	ادامه تغییرات ساختاری و ....
هفدهم	متغیرهای استوکاستیک (Stochastic) و متغیرهای ابزاری (نحوه تصریح، برآورد و آزمون)،
هجدهم	ادامه متغیرهای استوکاستیک ...
نوزدهم	کار با نرم‌افزار در راستای انجام پروژه عملی
بیستم	سیستم معادلات (سیستم خطی و غیرخطی، نحوه برآورد، آزمون و کاربرد آن‌ها)
بیست و یکم	ادامه سیستم معادلات ...
بیست و دوم	ادامه سیستم معادلات ....
بیست و سوم	کار با نرم‌افزار در راستای انجام پروژه عملی
بیست و چهارم	الگوهای لاجیت، پروبیت و توبیت (نحوه تصریح، برآورد و کاربرد آن‌ها)
بیست و پنجم	ادامه الگوهای لاجیت، ...
بیست و ششم	ادامه الگوهای لاجیت، ...
بیست و هفتم	رفتار سری‌های زمانی، پایایی، آزمون‌های مربوطه
بیست و هشتم	ادامه رفتار سری‌های زمانی ...
بیست و نهم	ادامه رفتار سری‌های زمانی ...
سی‌ام	ادامه رفتار سری‌های زمانی ...
سی و یکم	کار با نرم‌افزار در راستای انجام پروژه عملی
سی و دوم	ادامه کار با نرم‌افزار....

به نام خدا

طرح درس (Course Plan)