



دانشگاه کردستان
فرم طرح درس

| اطلاعات اولیه درس | | | | | |
|------------------------|---------------|------------|--|-----------------------|----------------|
| عنوان درس | مقطع | نام مدرس | زمان بندی هفتگی | نوع درس | تعداد واحد درس |
| اقتصاد سنجی ۱۰۴۲۰۰۳ | کارشناسی ارشد | فاتح حبیبی | شنبه ۸-۱۰ (هفته‌های فرد) یکشنبه ۸-۱۰ | اجباری ■ اختیاری □ | ۳ واحد |

| پیش نیازها |
|---|
| ندارد |
| نرم افزارهای مورد استفاده در طول دوره |
| ۱) نرم افزار (Excel) برای استخراج داده‌ها از بانک‌های اطلاعاتی ۲) نرم افزارهای (Eviews) و (Stata) برای تخمین و برآورد مدل‌ها |
| روش آموزش |
| ■ سخنرانی ■ پرسش و پاسخ ■ حل تمرین ■ کار با نرم افزار در سایت دانشکده ■ |
| منابع درس |
| ۱) مرجع اصلی: اقتصاد سنجی جلد (۱ و ۲)، دکتر علی سوری، انتشارات فرهنگ شناسی، ۱۳۹۴ ۲) مبانی اقتصاد سنجی، تألیف دامودار گجراتی، ترجمه حمید ابریشمی، انتشارات دانشگاه تهران، ۱۳۹۲. ۳) اقتصاد سنجی، دکتر حسین عباسی‌نژاد، انتشارات دانشگاه تهران، ۱۳۸۰. 4) Dougherty. C. (2015). Introduction to Econometrics. Fourth Edition. 5) Wooldridge, J.M. (2013). Introductory Econometrics, A Modern Approach. 6) Green, W.H. (2012). Econometrics analysis, 4th Edition. 7) https://www.Stata.com 8) https://www.Eviews.com 9) https://www.imf.org 10) https://www.databank.worldbank.org 11) https://www.amar.org.ir |

اهداف درس

افزایش توانایی دانشجویان در بکارگیری ابزارهای اقتصادسنجی در تبیین ارتباط کمی بین متغیرهای اقتصادی تحت شرایطی که فروض کلاسیک نقض می شود. ارائه مثالهای کاربردی براساس داده های اقتصاد ایران و تجزیه و تحلیل های اقتصادسنجی در کارهای پژوهشی و آماده ساختن دانشجویان برای تخمین و برآورد مدل های پایان نامه نیز از دیگر اهداف این درس می باشد.

آدرس الکترونیکی تماس با استاد

f.habibi@uok.ac.ir

ساعات مراجعه حضوری و رفع اشکال

بر اساس برنامه اعلام شده در سامانه گلستان و برنامه نصب شده در سر در اتاق شماره ۳۰۲ دانشجویان می توانند مراجعه نمایند.

کلاس حل تمرین

با توجه به ماهیت درس و بسته به شرایط کلاس در صورت لزوم کلاس حل تمرین برگزار خواهد شد. تاریخ و ساعات کلاس های حل تمرین پس از هماهنگی از طریق نماینده کلاس به اطلاع دانشجویان خواهد رسید.

| آزمون پایان ترم 30% | پروژه، سمینار 30% | آزمون های میان ترم 20% | مشارکت فعال هفتگی 20% |
|--|--|---|--|
| بر اساس تاریخ رسمی اعلامی در تقویم دانشگاهی برگزار خواهد شد. | با توجه به ماهیت درس هر یک از دانشجویان پروژه ای بر مبنای مباحث درسی مربوطه انتخاب و در پایان ترم و حداکثر یک هفته بعد از تاریخ امتحان پایان ترم تحویل خواهند داد. | در هفته اول کلاس، با هماهنگی دانشجویان دو آزمون میان ترم برگزار خواهد شد. | مشارکت فعال در کلاس های درس مشارکت در مباحث طرح سوال حل تمرین ارائه های کلاسی ارائه مدل هایی بر اساس داده های اقتصاد ایران |

| زمان بندی هفتگی | | |
|-----------------|--|--|
| شماره هفته | سر فصل ها | تکالیف، آزمون های میان ترم |
| ۱ | فصل اول: مقدمه ای بر الگوهای رگرسیون رگرسیون خطی ساده، رگرسیون دو متغیره، رگرسیون چند متغیره، | |
| ۲ | فصل دوم: نقض فروض کلاسیک ماهیت و پیامدهای واریانس ناهمسانی، روش (GLS)، ماهیت و پیامدهای همخطی، آزمون-های تشخیصی، تخمین ضرایب در هریک از موارد فوق | تخمین مدل در حالت نقض فروض کلاسیک |
| ۳ | فصل دوم: نقض فروض کلاسیک ماهیت و پیامدهای خودهمبستگی، آزمون های تشخیصی، تخمین ضرایب، | تخمین مدل در حالت نقض فروض کلاسیک |
| ۴ | فصل سوم: متغیرهای مجازی و آزمون تصریح مدل رگرسیون متغیر مجازی، آزمون متغیرهای مجازی و ثبات ضرایب، آزمون فرم تابعی مدل، حذف متغیرهای مهم، ورود متغیرهای نامرتبط در مدل، خطای اندازه گیری متغیرها | آزمونهای تشخیصی با استفاده از Eviews , Stata |
| ۵ | فصل چهارم: روش حداکثر درستنمایی تابع درستنمایی، تخمین زننده حداکثر درستنمایی، روش (GLS) | |
| ۶ | فصل پنجم: معادلات همزمان سیستم معادلات همزمان تعاریف و مفاهیم، تخمین معادلات فرم ساختاری از روش OLS، شناسایی و تشخیص معادلات فرم ساختاری (شرط درجه ای و رتبه ای)، فرم حل شده | حل مسئله معادلات همزمان |
| ۷ | فصل پنجم: معادلات همزمان تخمین سیستم معادلات همزمان، روش های تک معادله ایی (ILS, 2SLS)، روش های سیستمی (3SLS) | تخمین معادلات همزمان |
| ۸ | آزمون میان ترم اول | |
| ۹ | فصل ششم: مدل های خود رگرسیون برداری فرم ساختاری VAR، فرم استاندارد (حل شده) VAR، VAR مقید و نامقید، | تخمین مدل با استفاده از Eviews, Stata |
| ۱۰ | فصل هفتم: مدل های تصحیح خطای برداری (VECM) هم انباشتگی و مدل (VECM)، روش جوهانسون، آزمون اثر جوهانسون، بردارهای هم-انباشتگی، توابع واکنش در مدل های VECM | تخمین مدل با استفاده از Eviews, Stata |
| ۱۱ | فصل هشتم: سری های زمانی برخی مفاهیم سری های زمانی، فرآیند خود رگرسیونی (AR)، فرآیند میانگین متحرک (MA) | تخمین مدل با استفاده از Eviews, Stata |
| ۱۲ | فصل هشتم: سری های زمانی فرآیند ARMA، روش باکس-جنکینز (Box-Jenkins)، مدل های ARIMA، پیش بینی با استفاده از مدل های سری زمانی | |
| ۱۳ | آزمون میان ترم دوم | |

| | | |
|---|---|----|
| آزمون‌های ریشه واحد با استفاده Eviews, Stata | فصل هشتم: سریهای زمانی سری‌های زمانی مانا، آزمون ریشه واحد، آزمون ریشه واحد و تغییر ساختاری، هم‌انباشتنی، آزمون هم‌انباشتنی | ۱۴ |
| تخمین مدل با استفاده از Eviews | فصل نهم: مدل‌های با وقفه توزیعی اثرات تاخیری، تخمین مدل‌های با وقفه توزیعی، مدل‌های خود رگرسیون با وقفه توزیعی (ARDL) | ۱۵ |
| آزمون پایان ترم | | ۱۶ |