

اقتصادسنجی کاربردی
(کارشناسی ارشد)
پاییز ۹۱)
بسمه تعالی
دانشگاه تهران
دانشکده اقتصاد
دکتر مهرآرا و دکتر شاپور محمدی
مهدی نوری



هدف:

آشنا ساختن دانشجویان عزیز با کاربرد روش های اقتصادسنجی در مطالعات تجربی

طول ترم:

طبق مصوبه ستاد فرهنگی حداقل ۵۴ ساعت برای ارائه مطالب نظری لحاظ گردیده است که در طول ۱۸ هفته ارائه خواهد شد.

ساعت برگزاری کلاس:

شنبه - دوشنبه ۱۷-۱۵

منابع

- Applied Econometrics Time Series, W. Enders, 2004.
- An introduction to Applied Econometrics k. Patterson. 2000.
- اندرز، والترز؛ (۱۳۸۶)، اقتصاد سنجی سری های زمانی با رویکرد کاربردی، مترجمان: مهدی صادقی و سعید شوال پورف انتشارات امام صادق(ع)، چاپ اول، جلد اول و دوم.
- نوفرستی، محمد(۱۳۷۸)، ریشه واحد و همجمعی در اقتصاد سنجی، موسسه خدمات فرهنگی رسا، چاپ دوم.
- اقتصاد سنجی، رهیافت کاربردی؛ ۱۳۸۶، مترجم: شمس اله شیرین بخش، انتشارات آوای نور.
- اندرز، والترز؛ (۱۳۸۶)، اقتصاد سنجی سری های زمانی با رویکرد کاربردی، مترجمان: مهدی صادقی و سعید شوال پورف انتشارات امام صادق(ع)، چاپ اول، جلد اول و دوم.

- نوفرستی، محمد(۱۳۷۸)، ریشه واحد و همجمعی در اقتصاد سنجی، موسسه خدمات فرهنگی رسا، چاپ دوم.
- اقتصاد سنجی، رهیافت کاربردی؛ ۱۳۸۶، مترجم: شمس اله شیرین بخش، انتشارات آوای نور.
- اقتصادسنجی کاربردی: رویکردهای نوین، تألیف دکتر حمید ابریشمی، دکتر محسن مهرآرا، انتشارات دانشگاه تهران.

نحوه ارزشیابی

- | | |
|-----------------------------|--------|
| ارزشیابی بر اساس: | امتیاز |
| - یک نوبت آزمون | ۸۰٪ |
| - تمرین‌ها و مشارکت در کلاس | ۲۰٪ |

مطالب مورد تدریس

- پیش‌بینی
- معیارهای انتخاب الگو
- موضوعات کاربردی در دستگاه معادلات همزمان
- روش SUR
- آزمون‌های ثبات الگو
- مدل‌های غیرخطی
- روش حداکثر درست‌نمایی
- مدل‌هایی با متغیر وابسته محدود (مانند PROBIT و LOGIT و...)
- سری‌های زمانی
- داده‌های پانل
- روش GMM

- تحلیل های سرس زمانی
- هم‌انباشتگی (همبستگی متقابل)
- الگوهای تصحیح خطا (ECM)
- الگوهای تصحیح خطا برداری یا VECM
- سیستم دستگاه هم‌انباشته همزمان (SCS)
- شبیه سازی
- اقتصادسنجی بیزی
- روشهای کالمن- فیلتر (KALMAN – FIITER)
- روشهای شبیه‌سازی مونت- کارلو و bootstrapping
- کارگاه آموزشی نرم‌افزارهای اقتصادسنجی
- STATA, EVIEWS, MICROFIT, PCGIVE, MATLAB

منابع

- سوری، علی؛ اقتصاد سنجی، جلد ۱ و ۲ همراه با Eviews & Stata12، نشر فرهنگ شناسی
- Applied Econometrics Time Series, W. Enders, 2004.
- An introduction to Applied Econometrics k. Patterson. 2000.
- مهرگان، نادر؛ راهنمای استفاده از ایویوز؛ انتشارات نور علم
- اندرن، والترز؛ (۱۳۸۶)، اقتصاد سنجی سری های زمانی با رویکرد کاربردی، مترجمان: مهدی صادقی و سعید شوال پورف انتشارات امام صادق(ع)، چاپ اول، جلد اول و دوم.
- نوفرستی، محمد(۱۳۷۸)، ریشه واحد و همجمعی در اقتصاد سنجی، موسسه خدمات فرهنگی رسا، چاپ دوم.
- اقتصاد سنجی، رهیافت کاربردی؛ ۱۳۸۶، مترجم: شمس اله شیرین بخش، انتشارات آوای نور.
- اقتصادسنجی کاربردی: رویکردهای نوین، تألیف دکتر حمید ابریشمی، دکتر محسن مهرآرا، انتشارات دانشگاه تهران.

نحوه ارزشیابی

- | | |
|-----------------------------|--------|
| ارزشیابی بر اساس: | امتیاز |
| - یک نوبت آزمون | ۵۰٪ |
| - تمرین‌ها و مشارکت در کلاس | ۵۰٪ |

مطالب مورد تدریس

- مروری بر رگرسیون ۲ متغیره و K متغیره
- پیش‌بینی
- آزمون‌های ثبات الگو
- معادلات به ظاهر نامرتبط (SUR)
- موضوعات کاربردی در دستگاه معادلات همزمان
- مدل‌های غیرخطی
- روش GMM
- روش حداکثر درست‌نمایی
- مدل‌هایی با متغیر وابسته محدود (مانند PROBIT و LOGIT و...)
- تحلیل‌های سری‌های زمانی و معیارهای انتخاب الگو
- سری‌های زمانی نامانا
- هم‌انباشتگی
- الگوهای تصحیح خطا (ECM)
- الگوهای تصحیح خطا برداری یا VECM
- سیستم دستگاه هم‌انباشته همزمان (SCS)
- شبیه‌سازی
- اقتصادسنجی بیزینی
- روش‌های کالمن - فیلتر (KALMAN - FIITER)
- روش‌های شبیه‌سازی مونت- کارلو و bootstrapping
- اقتصادسنجی داده‌های پانل