

فهرست مطالب و برنامه کاری درسی اقتصادسنجی کاربردی کارشناسی دانشگاه شهید بهشتی

تعداد واحد: ۲

مدرس: مهدی یزدانی

صفحه دانشگاهی

ساعات کلاس: سه‌شنبه ۱۷-۱۵

ساعت رفع اشکال: دوشنبه ۱۲-۱۰

Email: ma_yazdani@sbu.ac.ir<http://facultymembers.sbu.ac.ir/yazdani/>

برنامه کاری در طول ترم:

۱- تنظیم گزارش تحقیقاتی	۲۰٪
۲- مشارکت در کلاس و حل تمرین	۲۰٪
۳- حضور در کلاس اجباری	
۴- امتحان میان‌ترم:	۳۰٪
تاریخ: ۱۴۰۰/۰۹/۰۲	
۴- امتحان پایان‌ترم:	۳۰٪
تاریخ: ۱۴۰۰/۱۰/۲۶	

هدف:

در دهه‌های اخیر علم اقتصادسنجی تحولات زیادی داشته است. با این وجود دست یافتن به علم روز بدون آگاهی از اقتصادسنجی کلاسیک و محدودیت‌های آن با امکان‌پذیر نیست. از این‌رو در درس اقتصادسنجی کاربردی ضمن تأکید بر مبانی و مفاهیم اقتصادسنجی کلاسیک، تلاش می‌گردد مباحث تکمیلی اقتصادسنجی کلاسیک تا حد امکان در کلاس ارائه گردد. از طرف دیگر فراگیری اقتصادسنجی نیازمند تسلط بر مفاهیم آماری و تمرین و ممارست دانشجویان است. از این‌رو بعد از ارائه مفاهیم نظری، تلاش می‌شود دانشجویان با نمونه‌ها و شواهد کاربردی مواجه شده و درک مطلب برای آن‌ها تسهیل گردد. انتظار می‌رود که دانشجویان علاوه بر آشنایی با یکی از نرم‌افزارهای اقتصادسنجی، آموخته‌های نظری خود را در قالب تصریح، تخمین، آزمون و پیش‌بینی یک نظریه اقتصادی ارائه نمایند. بر این اساس به طور خلاصه اهداف زیر را از این درس می‌توان بیان کرد:

- آشنایی با اصول و نظریه‌های اقتصادسنجی محض و ویژگی‌های آماری-اقتصادی روش‌های تخمین در به ثمر نشاندن نظریه‌های آموخته شده در علم اقتصاد.
- آشنایی با روش‌های اقتصادسنجی و کاربرد آن‌ها در ارزیابی‌های تجربی.
- شناخت نرم‌افزارهای اقتصادسنجی و چگونگی ارزیابی فروض آماری و برازش الگوهای اقتصادی.

منابع:

۱. منابع مربوط به مباحث تئوریک

- الف) گجراتی، دامودار، (۱۳۸۶)، **مبانی اقتصادسنجی**، ترجمه حمید ابریشمی، انتشارات دانشگاه تهران.
- B) Johnston, J. and J. DiNardo, (2003), **Econometric Methods**, McGra-Hill, 4th Edition.
- C) Greene, William H., (2003), **Econometric Analysis**, Prentice Hall, 5th Edition.
- D) Judge, G.G, R.C. Hill, W.E. Griffiths, H. Lutkepohl and T.C. Lee, (1982), **Introduction to the Theory and Practice of Econometrics**, John Wiley & Sons Inc.
- E) Baltagi, Badi H., (2008), **Econometrics**, Springer-Verlag Berlin Heidelberg, 4th Edition.
- F) Baltagi, Badi H., (2005), **Econometric Analysis of Panel Data**, John Wiley & Sons Inc., 3th Edition.
- G) Harris, R. and R. Sollis, (2003), **Applied Time Series: Modelling and Forecasting**, John Wiley & Sons Inc.
- H) Maddala, G.S., (1992), **Introduction to Econometrics**, macmillan Publishing Company, 2th Edition.

۲. منابع مربوط به کاربرد اقتصادسنجی و نرم افزار

- الف) والتر اندر، (۱۳۸۶)، **اقتصادسنجی سری های زمانی با رویکرد کاربردی**، ترجمه مهدی صادقی و سعید شوال پور تهران، انتشارات دانشگاه امام صادق.
- ب) نوفرستی محمد، (۱۳۸۷)، **ریشه واحد و هم جمعیتی در اقتصادسنجی**، انتشارات رسا، تهران.
- ج) شیرین بخش، شمس اله و زهرا حسن خوانساری، (۱۳۸۴)، **کاربرد Eviews در اقتصادسنجی**، تهران، انتشارات پژوهشکده امور اقتصادی.
- د) تشکینی، احمد، (۱۳۸۴)، **اقتصادسنجی کاربردی به کمک Microfit**، موسسه فرهنگی هنری دیباگران تهران.
- ه) مرادی، علیرضا، (۱۳۸۹)، **کاربرد Eviews در اقتصادسنجی**، تهران، انتشارات جهاد دانشگاهی.

روش کار:

تاکید کلاس های اصلی بر آموزش نکات کلیدی و تفهیم مفاهیم اصلی است که در کتاب آمده است. هر یک از سرفصل های ارائه شده در زیر پوشش داده خواهد شد. در طول ترم به منظور آشنایی با نرم افزارهای اقتصادسنجی و کاربرد آموزه های تئوریک در قالب تحلیل های کاربردی، در هر جلسه مباحث آموزشی در این زمینه ارائه خواهد شد.

برنامه کاری:

منابع	مطلب قابل ارائه	تاریخ	هفته
فصل هفتم و هشتم کتاب گجراتی	مدل های رگرسیون تک معادله ای - تحلیل رگرسیونی چند متغیره: مسأله تخمین - تحلیل رگرسیونی چند متغیره: مسأله استنتاج آماری	۳۰ شهریور	۱
فصل ششم کتاب جانستون فصل دهم کتاب گجراتی	نقض فروض مدل کلاسیک - همخطی	۶ مهر	۲

	تعطیل	۱۳ مهر	۳
فصل ششم کتاب جانستون فصل دهم کتاب گجراتی	نقض فروض مدل کلاسیک - همخطی	۲۰ مهر	۴
فصل ششم کتاب جانستون فصل یازدهم کتاب گجراتی	نقض فروض مدل کلاسیک - ناهمسانی واریانس	۲۷ مهر	۵
فصل ششم کتاب جانستون فصل یازدهم کتاب گجراتی	نقض فروض مدل کلاسیک - ناهمسانی واریانس	۴ آبان	۶
فصل ششم کتاب جانستون فصل یازدهم و دوازدهم کتاب گجراتی	نقض فروض مدل کلاسیک - ناهمسانی واریانس - خودهمبستگی	۱۱ آبان	۷
فصل ششم کتاب جانستون فصل دوازدهم کتاب گجراتی	نقض فروض مدل کلاسیک - خودهمبستگی	۱۸ آبان	۸
فصل ششم کتاب جانستون فصل دوازدهم کتاب گجراتی	نقض فروض مدل کلاسیک - خودهمبستگی	۲۵ آبان	۹
تا انتهای فصل یازدهم کتاب گجراتی	امتحان میان ترم	۲ آذر	۱۰
فصل سیزدهم کتاب گجراتی	نقض فروض مدل کلاسیک - مدلسازی اقتصادسنجی	۹ آذر	۱۱
فصل سیزدهم کتاب جانستون فصل پانزدهم کتاب گجراتی	نقض فروض مدل کلاسیک - رگرسیون روی متغیرهای موهومی	۱۶ آذر	۱۲
فصل سیزدهم کتاب جانستون فصل پانزدهم و شانزدهم کتاب گجراتی	مباحثی چند در اقتصادسنجی - رگرسیون روی متغیرهای موهومی - رگرسیون روی متغیر وابسته موهومی	۲۳ آذر	۱۳
فصل سیزدهم کتاب جانستون فصل شانزدهم کتاب گجراتی	مباحثی چند در اقتصادسنجی - رگرسیون روی متغیر وابسته موهومی	۳۰ آذر	۱۴
فصل هشتم کتاب جانستون فصل هفدهم کتاب گجراتی	مباحثی چند در اقتصادسنجی - مدل‌های خودرگرسیون و با وقفه توضیحی	۷ دی	۱۵
فصل هجدهم، نوزدهم و بیستم کتاب گجراتی	مدل‌های معادلات همزمان - مدل‌های معادلات همزمان - مسأله تشخیص - روش‌های معادلات همزمان	۱۴ دی	۱۶
مطالب از قسمت میان ترم به بعد	امتحان پایان ترم	۱۴۰۰/۱۰/۲۸	۱۷