



باسمه تعالی

عنوان درس: اقتصاد سنجی ۲ مقطع: کارشناسی رشته: اقتصاد مدرس: ناصر الهی

۱- معرفی و اهداف درس

می‌توان اقتصادسنجی کلاسیک را آمیزه‌ای از نظریه‌های اقتصادی و آمار دانست که برای آزمون فرضیه‌های اقتصادی خرد و کلان بکار گرفته می‌شود. با فرض این که در اقتصادسنجی ۱ درک عمیقی از مدل‌های رگرسیونی خطی بر اساس شیوه حداقل مربعات خطا در جارجوب فروض کلاسیک دریافت کرده‌اید و خواص آماری آن را فرا گرفته‌اید. در این درس در مورد رگرسیون K متغیره خطی در شرایطی که یکی از فروض کلاسیک نقض شده است بحث می‌شود و ضمن انجام آزمون‌های لازم بازتشنیسی نسبت به برقراری یا عدم برقراری فروض کلاسیک، پیامدهای کاربست روش OLS بررسی و جایگزین‌های مناسب برای حداقل مربعات معمولی معرفی خواهد شد.

همچنین از آنجا که محیط اقتصادی همواره دستخوش تغییرات جدی است در مورد شکست ساختاری و پیامدهای آن در رگرسیون بحث خواهد شد و راه‌هایی برای استخراج نقاط شکست معرفی خواهد شد. در همین ارتباط متغیرهای مجازی برای توجیه تغییرات رفتار متغیر وابسته در گذر از شکست‌های ساختاری معرفی می‌شود که راه را برای تاثیر متغیرهای کیفی در رگرسیون را نیز فراهم می‌سازد.

آخرین مدل مورد بررسی در این دوره، مدل‌هایی خواهد بود که متغیر وابسته آن کیفی است.

۲- معرفی استاد ناصر الهی

۳- پیش‌نیازهای درس

- اقتصادسنجی ۱ کارشناسی رشته اقتصاد

۴- منابع:

الف) منابع اصلی

- گجراتی، دامودار، مبانی اقتصادسنجی جلد ۲، مترجم: ابریشمی، حمید، مؤسسه انتشارات و چاپ دانشگاه تهران، ۱۳۹۸

ب) منابع برای مطالعه بیشتر

- Greene, W. H. *Econometric Analysis*, 8th ed. Pearson Education, Boston (۲۰۱۸).

۵- تکالیف دانشجوی

الف) پروژه: ۴ از ۲۰

ب) ارزشیابی میان ترم: ۴ از ۲۰

ج) ارزشیابی پایان ترم: ۱۲ از ۲۰

۶- زمان‌بندی (توزیع مباحث و مشخص کردن عناوین درسی برای هر جلسه تا پایان ترم)

جلسه اول: مروری بر مطالب اقتصادسنجی ۱

جلسه دوم: استخراج مدل رگرسیون K متغیره به شیوه ماتریسی

جلسه سوم: آزمون‌های معناداری ضرایب و رگرسیون

جلسه چهارم: همخطی

جلسه پنجم: خودهمبستگی

جلسه ششم: واریانس ناهمسانی

جلسه هفتم: شکل تبعی نادرست رگرسیون

جلسه هشتم: پیامدهای ورود متغیر نامرتب

جلسه نهم: پیامدهای حذف متغیر مرتبط

جلسه دهم: درآمدی بر نامانایی متغیرها

جلسه یازدهم: نقد لوکاس و مشکل شکست ساختاری

جلسه دوازدهم: متغیرهای موهومی (Dummy variables)

جلسه سیزدهم: متغیرهای کیفی

جلسه چهاردهم: ماهیت مدل کیفی LPM

جلسه پانزدهم: مدل logit

جلسه شانزدهم: مدل probit

۷- راه‌های ارتباطی و میزان زمان تقریبی برای دریافت پاسخ: طی ۱۰ روز به ایمیل‌های دریافتی از دانشجویان به elahi.mofid@gmail.com پاسخ داده می‌شود به شرطی که در **subject** ایمیل فقط **metrics14012** (بدون هیچ کاراکتر اضافی و یا کمتر) نوشته شده باشد و در ابتدای ایمیل نام و نام خانوادگی دانشجو ذکر شده باشد. همچنین دانشجویان بایستی هر هفته پروژه خود را نیز به همین آدرس ارسال کنند.