



باسمه تعالی

مدرس: ناصر الهی

رشته: اقتصاد

مقطع: کارشناسی

عنوان درس: اقتصاد سنجی ۲ (۱۴۰۲-۱)

۱- معرفی و اهداف درس

- این دوره ادامه اقتصادسنجی ۱ است و مباحث پیشرفته تئوری و عملی اقتصاد سنجی را پوشش می دهد. این دوره:
- دانشجویان را با مسئله استنتاج در تحلیل رگرسیون چند گانه و روش های آزمون فرضیه و فواصل اطمینان آشنا می سازد.
 - مفاهیم، تکنیک های مدل سازی و مشخصات یک مدل قابل قبول را ارائه می دهد.
 - پیامدهای نقض فروض کلاسیک را تبیین می سازد، آزمون های خود تشخیصی مطرح در مورد نقض هر یک از فروض کلاسیک را مورد بررسی قرار می دهد و راه های درمان آن را می آموزد.
 - دانشجویان را در معرض توسعه های مختلف مدل های رگرسیونی قرار می دهد.
 - با استفاده از ابزارهای نرم افزاری مناسب، مهارت های دانشجویان را در به کارگیری روش های اقتصادسنجی در داده های دنیای واقعی توسعه می دهد.

۲- معرفی استاد: ناصر الهی

۳- پیش نیازهای درس:

دانشجویانی که این درس را اخذ می کنند باید اقتصاد سنجی ۱ را با موفقیت به پایان رسانده باشند آنها همچنین باید در مورد جبر ماتریسی، انتگرال و آمار اطلاعات کافی داشته باشند و تا حدی با مفاهیم حساب دیفرانسیل آشنا باشند..

۴- منابع:

منابع اصلی:

کتاب اصلی این دوره عبارت است از:

- گجراتی، دامودار. مبانی اقتصاد سنجی (جلد: اول). مترجم: حمید ابریشمی ویرایش نوزدهم، دانشگاه تهران، ۱۴۰۱. (فصل ۹)
- گجراتی، دامودار. مبانی اقتصاد سنجی (جلد: دوم). مترجم: حمید ابریشمی ویرایش چهاردهم، دانشگاه تهران، ۱۴۰۰

منابع برای مطالعه بیشتر:

- Gujarati, Damodar. Econometrics by Example. United Kingdom, Palgrave Macmillan, 2014.
- Gujarati, Damodar N, and Porter, Dawn C.. Essentials of Econometrics. United Kingdom, McGraw-Hill Education, 2009.

۵- تکالیف دانشجو

الف) ارزشیابی مستمر و پروژه (دانشجویان در طول نیمسال باید پروژه خود را به طور هفتگی تکمیل کنند و بخش تکمیل شده را قبل از مهلت مقرر به صورت الکترونیکی از طریق ایمیل ارسال کنند. ارسال های دیر هنگام پذیرفته نمی شود. تکالیف بر اساس صحت، کامل بودن، وضوح و اصالت درجه بندی خواهند شد. مختصات پروژه و توضیحات لازم در کلاس ارائه خواهد شد: ۴ نمره؛

ب) ارزشیابی میان ترم (۱۴ آبان ۱۴۰۲): ۴ نمره؛

ج) ارزشیابی پایان ترم: ۱۲ نمره

توجه: توصیه می شود که دانشجویان ماشین حساب اختصاصی برای امتحان به همراه داشته باشند. در صورت نداشتن ماشین حساب، باید محاسبات دستی انجام شود که ممکن است بسیار وقت گیر باشد.

۶- مباحث

- فصل ۹: روش ماتریسی مدل رگرسیون خطی (از جلد اول)
- فصل ۱: همخطی (از این به بعد مربوط به جلد دوم است)
- فصل ۲: ناهمسانی واریانس
- فصل ۳: خود همبستگی
- فصل ۴: مدلسازی اقتصادسنجی
- فصل ۵: مدلسازی اقتصادسنجی ۲
- فصل ۶: رگرسیون بر روی متغیرهای موهومی
- فصل ۷: رگرسیون بر روی متغیر وابسته موهومی
- فصل ۸: مدل های خود رگرسیونی و با وقفه توزیعی

- فصل ۹: مدل‌های معادلات همزمان
- فصل ۱۰: مساله تشخیص
- فصل ۱۱: روشهای معادلات همزمان

۷- راه‌های ارتباطی

- حضور در دفتر در ساعات مشاوره دانشجویی به ترتیب تقاضا
- ایمیل: elahi.mofid@gmail.com (لطفا در subject بنویسید metrics14021)