به نام ایزد دانا

(کاربرگ طرح درس) تاریخ به­روز رسانی:

دانشکده ............................ دوم سال تحصیلی **1397**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| مقطع: کارشناسی□ کارشناسی ارشد■ دکتری□ | تعداد واحد: نظری**3** عملی... | فارسی: **اقتصاد سنجی** | نام درس |
| پیش­نیازها و هم­نیازها: **ندارد** | لاتین: |
| شماره تلفن اتاق: **3578** | مدرس/مدرسین: **علیرضا عرفانی** |
| منزلگاه اینترنتی: | پست الکترونیکی: |
| برنامه تدریس در هفته و شماره کلاس: **سه شنبه 13-14 و چهارشنبه 8-10**  |
| اهداف درس: **آشنایی دانشجویان با روشهای برآورد و آزمون الگوهای اقتصادی- آشنایی با مدلهای سریهای زمانی** |
| امکانات آموزشی مورد نیاز: |
| امتحان پایان­ترم | امتحان میان­ترم | ارزشیابی مستمر(کوئیز) | فعالیت­های کلاسی و آموزشی | نحوه ارزشیابی |
| **60** | **30** | **5** | **5** | درصد نمره |
| **اقتصاد سنجی تالیف جفری. ام. وولدریج- اقتصاد سنجی تالیف دامودار گجراتی- اقتصاد سنجی تالیف مسعود درخشان** | منابع و مآخذ درس |

**بودجه­بندی درس**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **توضیحات** | **مبحث** | **شماره هفته آموزشی** |
|  | **رگرسیون ساده و روش برآورد آن** | **1** |
|  | **فروض جمله اخلال** | **2** |
|  | **رگرسیون چند متغیره و بیان ماتریسی برآورد آن** | **3** |
|  | **نقض فروض جمله اخلال**  | **4** |
|  | **تحلیل رگرسیون با داده های سریهای زمانی** | **5** |
|  | **مفهوم مانایی سری های زمانی مانا و غیر مانا** | **6** |
|  | **خود همبستگی و ناهمسانی واریانس در سری های زمانی** | **7** |
|  | **روشهای رفع خود همبستگی و ناهمسانی واریانس** | **8** |
|  | **کاربرد داده های پانل** | **9** |
|  | **اثرات ثابت و اثرات تصادفی** | **10** |
|  | **متغیرهای ابزاری و کاربرد آنها** | **11** |
|  | **سیستم معادلات همزمان** | **12** |
|  | **روش حداقل مربعات دو مرحله ای** | **13** |
|  | **ریشه واحد و آزمون های آن** | **14** |
|  | **هم جمعی و مدلهای تصحیح خطا** | **15** |
|  | **مدلهای ARCH و GARCH** | **16** |