



به نام ایزدوانا

نیمسال دوم سال تحصیلی ۹۸/۹۷

دانشکده ریاضی، آمار و علوم کامپیوتر

نام درس		فارسی: اقتصاد سنجی کاربردی	تعداد واحد: نظری ۴	مقطع: کارشناسی • کارشناسی ارشد □ دکتری □
		لاتین: Applied Econometrics	پیش نیازها و هم نیازها:	
مدرس/مدرسین: دکتر علیرضا بحیرایی		شماره تلفن اتاق:		
پست الکترونیکی: alireza.bahiraie@yahoo.com		منزلگاه اینترنتی:		
برنامه تدریس در هفته و شماره کلاس: شنبه ۸-۱۰ و یکشنبه ۸-۱۰				
اهداف درس: هدف این درس آموزش ابزارهای لازم برای استخراج جواب برای یک سوال اقتصادی است. بدین منظور دانشجو باید در درس های اقتصاد کلان و اقتصاد خرد آموخته باشد که چگونه می تواند سوال مناسب را تعریف کند. همچنین باید درک درستی از داده های مورد نیاز برای پاسخ به سوال بدست آورده باشد.				
امکانات آموزشی مورد نیاز: ویدیو پروژکتور				
نحوه ارزشیابی	فعالیت های کلاسی و آموزشی	ارزشیابی مستمر (کوئیز)	امتحان میان ترم	امتحان پایان ترم
درصد نمره	۲		۸	۱۲
منابع و مآخذ درس		<ul style="list-style-type: none"> - Gujarati A. Applied econometrics, Princetone Hall, ۱۹۹۰. - دکتر ابریشمی، مبانی اقتصاد سنجی، انتشارات دانشگاه تهران - Madalla J. Advanced econometrics, Willey and Sons, ۲۰۱۰ 		

بودجه بندی درس

شماره هفته آموزشی	مبحث	توضیحات
۱	مقدمه ای بر اقتصادسنجی، مبانی آماری و ریاضی	
۲	مدل رگرسیون خطی کلاسیک، بسط مدل رگرسیون خطی	
۳	فروض کلاسیک رگرسیون و نقض آنها	
۴	مدل های سری زمانی تک متغیره و پیش بینی با این مدل ها	
۵	مدل های چند متغیره و پیش بینی با این مدل ها	
۶	مدل سازی روابط بلندمدت در اقتصاد مالی (هم انباشتگی انگل گرنجر-جوهانسن جوسلیوس)	
۷	مدل سازی بی ثباتی و همبستگی (ARCH-GARCH-EGARCH)	
۸	مدل سازی بی ثباتی و همبستگی (GJR-GARCH in Mean)	
۹	مدل های رژیم سویچینگ (تار-استار-مارکوف سویچینگ)	
۱۰	مدل داده های تابلویی-پانل دیتا	
۱۱	مدل های با متغیر وابسته محدود شده	
۱۲	روش های شبیه سازی مونت کارلو	
۱۳	روش های شبیه سازی بوت استرپ و... / نرم افزار eviews	
۱۴	خود همبستگی و تستها و روشهای تشخیص و رفع	
۱۵	ناهمسانی واریانس و تستها و روشهای تشخیص و رفع	
۱۶	هم خطی و تستها و روشهای تشخیص و رفع	