

## به نام خدا

دانشگاه شاهرود، دانشکده اقتصاد و مدیریت، گروه اقتصاد

طرح درس اقتصاد سنجی کارشناسی ارشد برنامه‌ریزی سیستم‌های اقتصادی



دکتر علی دهقانی، عضو هیات علمی گروه اقتصاد دانشگاه شاهرود، نیمسال اول سال تحصیلی ۱۳۹۲-۱۳۹۳

هدف: توانمند کردن دانشجویان به منظور آزمون تجربی تئوری‌ها و مدل‌های اقتصادی

پیشنیاز: دروس آمار (۱)، آمار (۲)، ریاضی (۱)، ریاضی (۲)، اقتصاد خرد (۲)، اقتصاد کلان (۲)، اقتصاد سنجی و اقتصاد سنجی کاربردی دوره کارشناسی رشته اقتصاد

عنوان سرفصل‌ها: مدل‌های غیرخطی STAR، LSTAR، STAR، مدل‌های داده‌های تابلویی SPD، DPD، مدل با اثرات ثابت، مدل با اثرات تصادفی، مدل Pooling، مدل‌های ناپارامتریک، Rank Regression، مدل‌های Discreet Choice Models، رویکرد GMM در داده‌های مقطعی، داده‌های سری زمانی، داده‌های ترکیبی، مدل‌های سری زمانی، VAR، SVAR و ...، مدل‌های ARCH و GARCH.

نرم‌افزارهای اقتصادسنجی: EViews, Stata, JMalti, Microfit,

منابع:

۱- مبانی اقتصادسنجی، دامودار گجراتی، جلد ۱ و ۲، ترجمه حمید ابریشمی.

- ✓ *Principles of Econometrics*, Fourth Edition. by R. Carter Hill, William E. Griffiths and Guay C. Lim. *Principles of Econometrics*, 4th Edition, is an introductory book.
- ✓ <http://faculty.arts.ubc.ca/dwhistler/326UBC/lectures.htm>
- ✓ <http://www.soderbom.net/metrix2.htm>
- ✓ Enders, W (2004). *Applied Econometrics Time Series*. John Wiley and Sons Press, int.

ارزشیابی دانشجویان:

چاپ یک مقاله علمی دارای مدل اقتصادسنجی (مقاله سمینار، همایش و یا مجلات دارای هیات تحریریه و مجوز چاپ از وزارت فرهنگ و ارشاد اسلامی و فاقد درجه علمی ترویجی یا علمی پژوهشی، مقاله مجله دارای رتبه علمی ترویجی، مقاله مجله دارای رتبه علمی پژوهشی و یا ISI)، تکالیف کلاسی، امتحان میان‌ترم، امتحان پایان‌ترم