

بنام خدا
« فرم طرح درس »

دانشکده: منابع طبیعی و محیط زیست **رشته:** اقتصاد انرژی **گرایش:** - **مقطع:** کارشناسی ارشد
نام درس: اقتصادسنجی **تعداد واحد نظری:** ۳ **تعداد واحد عملی:** ۰ **عنوان درس پیشنهادی:**
نام مدرس: دکتر نصرت الله عباس زاده **تمام وقت** **نیمه وقت** **مدعو** **محل برگزاری:** کلاس آزمایشگاه

هدف کلی درس :

آشنایی دانشجویان با تکنیک‌های اقتصادسنجی و استفاده از آن در تحلیل‌های مرتبط

| رئوس مطالب | |
|---------------------|---|
| هفته اول | مدل رگرسیون خطی کلاسیک چندمتغیره ➤ فروض کلاسیک ➤ روش حداقل مربعات معمولی (OLS) ➤ قضیه GAUSS - MARKOV |
| هفته دوم | ➤ ضریب تعیین ➤ ماتریس‌های اساسی در تجزیه و تحلیل رگرسیون ➤ مدل رگرسیون بر حسب انحراف از میانگین |
| هفته سوم | معنی دار بودن ضرایب رگرسیون و فاصله اطمینان |
| هفته چهارم | آزمون مجموعه‌ای از محدودیتهای خطی روی ضرایب |
| هفته پنجم | الگوی رگرسیون مقید و نامقید آزمون تغییرات ساختاری |
| هفته ششم | روش حداقل مربعات تعمیم یافته (GLS) |
| هفته هفتم | ماتریس اطلاعات - حد پایین رانو و کرامر |
| هفته هشتم | نقض فروض کلاسیک: واریانس ناهمسانی |
| هفته نهم | نقض فروض کلاسیک: خودهمبستگی |
| هفته دهم | نقض فروض کلاسیک: همخطی و خطای تصریح |
| هفته یازدهم | رگرسیون بر روی متغیرهای موهومی ➤ متغیرهای موهومی بعنوان متغیر توضیحی |
| هفته دوازدهم | ➤ متغیرهای موهومی بعنوان متغیر وابسته |
| هفته سیزدهم | سیستم معادلات همزمان |
| هفته چهاردهم | رگرسیونهای به ظاهر نامرتبط (SUR) |
| هفته پانزدهم | تحلیل مدل‌های سری زمانی ➤ معرفی مفاهیم و انواع فرآیندهای سری زمانی |
| هفته شانزدهم | ➤ آزمون ریشه واحد و هم‌انباشتگی |

نحوه ارزشیابی فعالیت دانشجویی در طی دوره:

- ارزشیابی مستمر
- امتحان میان ترم
- ارائه پروژه
- امتحان نهایی

منابع مطالعاتی:

- ۱- مبانی اقتصادسنجی - دامودار گجراتی - ترجمه حمید ابریشمی - جلد دوم
- ۲- Econometric Analysis - William H. Greene
- ۳- Econometric Method - Jack Johnston & John Dinardo
- ۴- ریشه واحد و همجمعی در اقتصاد سنجی - محمد نوفرستی