

نام درس : اقتصادسنجی پیشرفته

پیش نیاز یا همزمان : اقتصادسنجی

تعداد واحد : ۳ (۳ واحد نظری)

نوع واحد : نظری

شماره درس : ۱۲

هدف کلی درس :

هدف از این درس آشنا کردن دانشجویان با مطالب پیشرفته تر اقتصادسنجی که کاربرد فراوانی در تحقیق در اقتصاد سلامت دارند می باشد. اهم مطالب ارائه شده در این درس شامل مدل های رگرسیون چند متغیره و تخمین حداقل مربعات در آنها، رگرسیونهای تجزیه شده، به خوبی برازش و تحلیل واریانس در مدل های چند متغیره، خصوصیات برآورد کننده های حداقل مربعات در مدل های چند متغیره، آزمون فرض و پیش بینی در مدل های رگرسیون چند متغیره، مدل رگرسیون غیر خطی، مدل های با داده های تابلویی، مدل های با معادلات همزمان، مدل های سری زمانی.

رئوس مطالب (۵۱ ساعت نظری) :

- فرضیات کلاسیک در مدل های رگرسیون چند متغیره
- تخمین حداقل مربعات معمولی در مدل های رگرسیون چند متغیره
- رگرسیون های تجزیه شده و تخمین حداقل مربعات در مورد این رگرسیونها
- خوبی برازش و تحلیل واریانس در مدل های رگرسیون چند متغیره
- خصوصیات برآورد کننده های حداقل مربعات در مدل های رگرسیون چند متغیره
- آزمون فرض و پیش بینی
- آزمون فرض مربوط با مجموعه ای از قیود خطی
- تشکیل فاصله اطمینان در مدل های رگرسیون چند متغیره
- برآورد کننده های حداقل مربعات مقید.
- آزمون تغییرات ساختاری در مدل های رگرسیون چند متغیره
- آزمونهای متفاوت مرتبط با پایداری مدل رگرسیون چند متغیره
- پیش بینی براساس مدل های رگرسیون چند متغیره
- نتیجه گیری فصل و ارائه مقاله های مرتبط با فصل
- مدل های غیر خطی در اقتصادسنجی
- خطی کردن مدل های غیر خطی در اقتصادسنجی
- برآورد کننده حداقل مربعات معمولی غیر خطی
- انواع برآورد کننده های مرتبط با مدل های غیر خطی رگرسیون
- برآورد کننده حداکثر راستنمایی در مدل های غیر خطی
- برآورد کننده متغیرهای ابزاری در مدل های غیر خطی
- برآورد کننده حداقل مربعات غیر خطی دو مرحله ای
- آزمون فرض در مدل های غیر خطی
- نتیجه گیری و انجام چند تمرین در زمینه فصل



- داده های تابلویی و دلیل وجود آنها در اقتصاد سنجی
- مدل‌های با داده های تابلویی در اقتصاد سنجی
- مدل‌های با اثرات ثابت و تصادفی
- آزمون مرتبط با اثرات تصادفی
- آزمون هاسمن در رابطه با اثرات ثابت یا تصادفی
- مدل‌های پویایی اقتصاد سنجی با داده های تابلویی
- معادلات همزمان در مقابل مدل‌های تک معادله ای
- فرم کلی مدل‌های همزمان خطی
- فرم ساختاری و فرم خلاصه شده در معادلات همزمان
- مسئله مشخص نمائی در مدل‌های همزمان
- روش های برآورد در مدل‌های رگرسیون همزمان
- روش حداقل مربعات و حداقل مربعات غیر مستقیم
- روش متغیرهای ابزار و روش GMM
- روش تک معادله ای حداقل مربعات دو مرحله ای
- روش حداکثر راستمائی با اطلاعات محدود و با حداکثر اطلاعات
- روش تخمین سیستمی
- روش تخمین حداقل مربعات سه مرحله ای
- آزمون مشخص نمائی در مدل‌های رگرسیون همزمان
- مدل‌های همزمان پویا
- نتیجه گیری و انجام چند تمرین در زمینه های مرتبط این فصل
- مدل‌های سری زمانی
- کلیات مربوط به مدل‌های سری زمانی
- فرآیند های تصادفی ایستا
- آزمون‌های مرتبط با ایستائی سری های زمانی
- مدل‌های سری زمانی تک متغیره و روش تخمین پارامترهای سری زمانی تک متغیره
- مدل‌های سری زمانی خود همبسته و میانگین متوسط
- مدل‌های سری زمانی چند متغیره

منابع درس :

- ۱- اقتصاد ایران، تدوین دکتر مسعود نیلی، موسسه عالی پژوهش در برنامه ریزی و توسعه، آخرین چاپ.
- ۲- اقتصاد بخش عمومی (هزینه های دولت)، دکتر جمشید پژویان، آخرین چاپ.
- ۳- اقتصاد کلان، دکتر تیمور رحمانی، آخرین چاپ.
- ۴- فصلنامه تامین اجتماعی، موسسه عالی پژوهش تامین اجتماعی، آخرین چاپ.
- ۵- اقتصاد سنجی کاربردی، کنت. اف. والیس، ترجمه دکتر حمید ابریشمی، آخرین چاپ.
- ۶- اقتصاد سنجی، مبانی و روشها، دکتر حسین عباسی نژاد، آخرین چاپ.



۷- اصول اندازه گیری کارآیی و بهره وری، دکتر علی امامی میبدی، موسسه مطالعات و پژوهشهای بازرگانی، آخرین چاپ.

۸- تئوری های اقتصادسنجی، یان کمنتا، آخرین چاپ.

9 - Gjgarati, D, Basic Econometrics, 3rd ed. New York. McGraw- till, Latest Edition

10- Greene, H. W, Econometrics Analysis, 4 red. New jersey, prentice- Itall. Latest Edition

11- Amemiya, T. Advanced Econometrics, Cambridge : harvard university press, Latest Edition.

12- Anderson, T. the statistical Analysis of time series. New York : John Wiley and sons, Latest Edition

13- Baltagi, B Econometrics Analysis of panel data. New York : John Wiley and sons, Latest Edition

14- BoX. GPV. Jenkins, Tim series Analysis : Forecasting and control, 2nd ed. San Francisco : Holden Day, Latest Edition

شیوه ارزیابی دانشجوی :

۵۰ درصد نمره نهایی این درس به آزمون پایان نیمسال، ۲۵٪ به حضور و مشارکت فعال در مباحث مطروحه در کلاس، و ۲۵٪ بقیه به تهیه و ارائه یک مقاله در قالب تکلیف کلاسی، در رابطه با موضوع درس و با تکیه بر شرایط کشور، تعلق خواهد گرفت. درصد متعلق به تکلیف کلاسی با عنایت به محتوی و ماهیت این درس می تواند با صلاحدید مدرس مربوط تا ۵۰٪ افزایش یابد. بدیهی است میزان افزایش یافته از ۵۰٪ سهم آزمون نهایی کسر خواهد شد.

