

هدف کلی درس :

هدف از این درس آشنایی با مطالب پیشرفته تر اقتصاد سنجی که کاربرد فراوانی در تحقیق در اقتصاد سلامت دارند می‌باشد. مهم مطالب ارائه شده در این درس شامل مدل‌های رگرسیون چند متغیره و تخمین حداقل مربعات در آنها، رگرسیونهای تجزیه شده، به خوبی برآش و تحلیل واریانس در مدل‌های چند متغیره، خصوصیات برآوردهای حداقل مربعات در مدل‌های چند متغیره، آزمون فرض و پیش بینی در مدل‌های رگرسیون چند متغیره، مدل رگرسیون غیر خطی، مدل‌های با داده‌های تابلوئی، مدل‌های با معادلات همزمان، مدل‌های سری زمانی.

رؤوس مطالب (۵۱ ساعت نظری) :

- فرضیات کلاسیک در مدل‌های رگرسیون چند متغیره

- تخمین حداقل مربعات معمولی در مدل‌های رگرسیون چند متغیره

- رگرسیونهای تجزیه شده و تخمین حداقل مربعات در مورد این رگرسیونها

- خوبی برآش و تحلیل واریانس در مدل‌های رگرسیون چند متغیره

- خصوصیات برآوردهای حداقل مربعات در مدل‌های رگرسیون چند متغیره

- آزمون فرض و پیش بینی

- آزمون فرض مربوط با مجموعه ای از قیود خطی

- تشکیل فاصله اطمینان در مدل‌های رگرسیون چند متغیره

- برآورد کننده‌های حداقل مربعات مقید.

- آزمون تغییرات ساختاری در مدل‌های رگرسیون چند متغیره

- آزمونهای مقاومت مرتبط با پایداری مدل رگرسیون چند متغیره

- پیش بینی براساس مدل‌های رگرسیون چند متغیره

- نتیجه گیری فصل و ارائه مثال‌های مرتبط با فصل

- مدل‌های غیر خطی در اقتصاد سنجی

- خطی کردن مدل‌های غیر خطی در اقتصاد سنجی

- برآورد کننده حداقل مربعات معمولی غیر خطی

- انواع برآوردهای مرتبط با مدل‌های غیر خطی رگرسیون

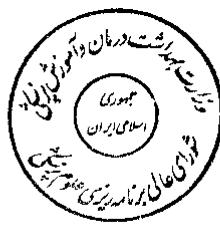
- برآورد کننده حداکثر راستنمائی در مدل‌های غیر خطی

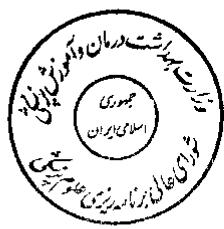
- برآورد کننده متغیرهای ابزاری در مدل‌های غیر خطی

- برآورد کننده حداقل مربعات غیر خطی دو مرحله‌ای

- آزمون فرض در مدل‌های غیر خطی

- نتیجه گیری و انجام چند تمرین در زمینه فصل





- داده های تابلوئی و دلیل وجود آنها در اقتصاد سنجی
- مدلهای با داده های تابلوئی 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 تابلوئی
- 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 راستنمائی یا 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 روشهای دکتر حسین عباسی نژاد، آخرین چاپ.

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

۸- تئوری های اقتصاد سنجی، یان کمتو، 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- ltall. 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 دانشجو :

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 صلاحیت مدرس مربوط تا ۰.۵٪ افزایش یابد. بدیهی است میزان افزایش یافته از ۰.۵٪ سهم آزمون نهایی کسر خواهد شد.

