

بسم الله الرحمن الرحيم

نام درس: تئوری اقتصادسنجی ۲. ، مقطع: دکتری، مدرس: دکتر حسن حیدری، تعداد واحد: ۲

اهداف درس:

تسلط بر الگوهای پیشرفته اقتصادسنجی

درک مبانی و کاربرد انواع مدل‌های اقتصادسنجی

توانایی به کارگیری مدل‌ها در عمل

محتوای درس:

Unit Root Econometrics

Theory of Forecasting

Vector Autoregression Models

Cointegration Analysis

Dynamic panel Data Models

Nonstationary Panel Data Models

Simulation-Based Estimation and Inference

Trend and Cycle Decomposition Methods.

منابع اصلی:

- Pesaran, H. "Time Series and Panel Data Econometrics", Oxford University Press, 2015.
- Greene, W. "Econometrics Analysis", Pearson, 2018.
- Helmut Luetkepohl, 2011. "Vector Autoregressive Models," Economics Working Papers ECO2011/30, European University Institute.
- Johansen, S. (2009). Cointegration: Overview and Development. In: Mikosch, T., Kreiß, JP., Davis, R., Andersen, T. (eds) Handbook of Financial Time Series. Springer, Berlin, Heidelberg. https://doi.org/10.1007/978-3-540-71297-8_29

نحوه ارزشیابی و امتحانات:

آزمون میان ترم: ۴۰ درصد

آزمون پایان ترم: ۵۰ درصد

پروژه عملی پایان ترم: ۲۰ درصد.