



مؤسسه عالی آموزش بانکداری ایران
دیرت آموزش حرفه‌ای



دوره آموزشی

اقتصادسنجی کاربردی پیشرفته با استفاده از

داده‌های ترکیبی و سری‌های زمانی

۴۲ ساعت

معرفی دوره

امروزه اقتصادسنجی به ابزاری بسیار قدرتمند در دست پژوهشگران تبدیل شده است. این ابزار با بهره‌گیری از روش‌های متنوع آمار و ریاضی، امکان آزمون نظریه‌ها، پیش‌بینی متغیرهای کلان و حتی وجود روابط متکی بر استدلال‌های اقتصادی را فراهم می‌سازد. رشد سریع این شاخه از علم اقتصاد و دسترسی به نرم‌افزارهای متنوع، این امکان را فراهم کرده است تا پژوهشگران حوزه‌های مختلف علوم اقتصادی و اجتماعی و حتی سایر حوزه‌ها بتوانند با انواع داده‌هایی که در دهه‌های قبل قابل استفاده نبودند، کار کنند. در این دوره تلاش می‌شود از مطالب خسته‌کننده نظری و اثبات قضیه‌ها عبور شود و با حذف فروض ساده‌کننده مدل‌سازی، مثال‌هایی عینی از دنیای واقعی ارائه گردد. همچنین در طی دوره، پرسش‌هایی متناسب با بحث مورد نظر ارائه و از شرکت‌کنندگان خواسته می‌شود پاسخ این پرسش‌ها را در همان جلسه یا جلسه بعدی با استفاده از نرم‌افزار ارائه نمایند. البته داده‌های مربوطه در اختیار شرکت‌کنندگان قرار می‌گیرد. این دوره در سه بخش اصلی و شماری زیر بخش ارائه می‌گردد. بخش اول مدل‌های داده‌های ترکیبی ایستا در نرم‌افزارهای Eviews & Stata را ارائه می‌کند. بخش دوم به مدل‌های پویا با داده‌های ترکیبی خواهد پرداخت و در نهایت بخش سوم مدل‌های سری‌های زمانی را مورد توجه قرار می‌دهد.

در این دوره، مطالب مربوط به سری‌های زمانی با عمق زیادی ارائه شده‌اند. به بیانی دیگر، مطالب به گونه‌ای ارائه شده‌اند که شرکت‌کنندگان را در شرایط پا گذاشتن به جرگه‌ی نگارش مقالات تجربی قرار دهد. افزون بر این، در این دوره، موضوعات خاص‌تری ارائه خواهد شد که در تحلیل‌های تجربی کاربرد گسترده‌ای داشته و قدرت تحلیل سری‌های زمانی و نیز پیش‌بینی آن‌ها را برای شرکت‌کنندگان میسر می‌سازد. در بخش دیگری از این دوره، شرکت‌کنندگان با ساختار داده‌ای دیگری تحت عنوان داده‌های ترکیبی آشنا می‌شوند. با فراگیری روش‌های پیشرفته در این حوزه، شرکت‌کنندگان برای تحلیل سیاستی آماده می‌شوند. این نوع از داده‌ها با توجه به عمومیت گسترده‌ای که دارند در مطالعات تجربی بسیار مورد استفاده هستند. از جمله ویژگی‌های مفید این نوع داده‌ها افزایش حجم نمونه و کنترل ناهمگنی در نمونه‌های مورد مطالعه است.

مخاطبین:

کلیه کارکنان بانک‌ها و
مؤسسات اعتباری غیر بانکی
حائز شرایط پیش نیاز دوره

طراحی شده برای یادگیری:

• مدل‌های داده‌های ترکیبی ایستا (Fix effect, Random Effect, Pooled) در نرم‌افزارهای Eviews & Stata شامل:

آزمون‌های تشخیصی مدل‌های Panel & Pooled Data Model

آزمون‌های تشخیصی مدل‌های استاتیک Fix & Random Effect Model

انتخاب بین مدل‌های استاتیک Fix & Random Effect Model با استفاده از سایر روش‌ها

آزمون‌های تشخیصی بین مدل‌های One-way Error Components و Two-way Error Components

مدل‌های داده‌های ترکیبی پویا در نرم‌افزارهای Eviews & Stata شامل:

مدل‌سازی گشتاورهای تعمیم یافته (GMM) برای حذف درون‌زایی و خودهمبستگی

مدل‌سازی روابط بلندمدت هم‌جمعی (Co-integration Method) شامل پیش‌آزمون‌ها، آزمون‌های اعتبارسنجی

(Diagnostic Checking) و روش‌های رفع نقض فروض کلاسیک

مدل‌های سری زمانی (Time Series Modeling) شامل:

مدل ARDL و انگل-گرنجر متقارن

مدل‌سازی هم‌جمعی آستانه‌ای (Threshold Co-integration Modeling)

مدل‌سازی برون‌زایی قوی، شکست ساختاری و رژیم شیف‌ت در راستای انتقاد لوکاس (exogeneity Structural Break and Regim Shift)

مدل‌سازی ARMA, ARIMA, ATCH, GARCH

آنلاین

مهلت ثبت نام: ۱۲ مهر ۱۴۰۱

تاریخ برگزاری: شنبه‌ها و چهارشنبه‌ها ۱۶ مهر الی ۳۰ آذر

ساعت ۸ الی ۱۰

مدرس دوره:

- دانشیار گروه اقتصاد دانشگاه شهید چمران اهواز

آدرس: خیابان پاسداران، سه راه ضرابخانه، پلاک ۱۹۵

www.ibi.ac.ir

شرایط ثبت نام: برای ثبت‌نام به پرتال مؤسسه (آموزش حرفه‌ای) به آدرس ذیل مراجعه شود.

<https://ideh.ibi.ac.ir/IdeaPortal>

هزینه دوره به ازای هر نفر: ۲۵,۰۰۰,۰۰۰ ریال به صورت خالص
هزینه دوره شامل محتوای آموزشی و صدور گواهی‌نامه می‌باشد.

شماره تماس: ۲۷۸۹۲۴۴۶-۲۷۸۹۲۴۵۸

تلفن گویا: ۴۱-۲۲۸۸۱۶۴۰

دورنگار: ۸۴۶۸۹۹

ایمیل: prof.training@ibi.ac.ir