

اقتصادسنجی کاربردی

داده‌های ترکیبی

با نرم افزار استاتا ۱۳

نویسندگان:

دکتر حسن فرازمند

دانشیار اقتصاد دانشگاه شهید چمران اهواز

صلاح ابراهیمی

دانشجوی دکتری اقتصاد دانشگاه شهید چمران اهواز



سازمان اسناد و کتابخانه ملی
جمهوری اسلامی ایران

سرشناسه: فرازند، حسن، ۱۳۳۵ -

عنوان و نام پدیدآور: اقتصادسنجی کاربردی داده‌های ترکیبی با نرم‌افزار استاتا ۱۳/ نویسندگان حسن فرازند، صلاح ابراهیمی.

مشخصات نشر: اهواز: پژوهندگان راه دانش، ۱۳۹۵. مشخصات ظاهری: ۱۷۲ ص.: مصور، جدول.

شابک: ۹۷۸-۶۰۰-۳۴۵-۱۰۲-۵

وضعیت فهرست نویسی: فیا

موضوع: نرم‌افزار استاتا

موضوع: اقتصادسنجی

یادداشت: کتابنامه: ص. ۱۶۹.

موضوع: Stata

موضوع: Econometrics

شناسه افزوده: ابراهیمی، صلاح، ۱۳۶۵ -

رده بندی کنگره: ۷۱۳۹۵ الف ۴ / HB ۱۳۹

رده بندی دیویی: ۳۳۰/۰۱۵۱۹۵

شماره کتابشناسی ملی: ۴۴۳۹۱۴۱



انشارات پژوهندگان راه دانش

ناشر: پژوهندگان راه دانش

شماره نشر: ۱۱۰۱

نام کتاب: اقتصادسنجی کاربردی داده‌های ترکیبی با نرم‌افزار استاتا ۱۳

نویسندگان: دکتر حسن فرازند - صلاح ابراهیمی

تیراژ: ۱۰۰۰

نوبت چاپ: اول

چاپ: تورنگ

حروفچینی و صفحه آرائی: گرافیک جوانه

چاپ اول: ۱۳۹۵

سایز: وزیری

شابک: ۹۷۸-۶۰۰-۳۴۵-۱۰۲-۵

قیمت: ۲۰۰۰۰ تومان

www.ketab.ir/pajo

حق چاپ و نشر محفوظ است.

طبق قانون حقوق نویسندگان و مصنفان هرگونه کپی برداری به هر روش پیگرد قانونی دارد.

۰۹۱۳۸۸۸۴۹۶۹ - ۶۶۱۲۰۵۵۴

تهران: خیابان ۱۶ آذر شمالی، ساختمان بعثت، طبقه سوم

۰۹۱۶۱۸۵۱۱۸ - ۳۳۲۰۲۸۰۲ - ۳۳۲۱۹۲۰۲

اهواز: خیابان نادری شرقی، نبش خیابان کرمی خراط

فهرست مطالب

مقدمه نویسنده‌گان	۱۱
فصل اول: حلدات	۱۳
مدل عمرمی داده‌ها، ترکیبی و انواع آن	۱۵
منابع پیشنهادی رای م نه بیشتر	۲۱
فصل دوم: مقدمه‌ای بر ن افزار استاتا	۲۳
نرم‌افزار استاتا	۲۵
چرا استاتا؟	۲۵
منوی استاتا	۲۸
محدودیت‌های استاتا	۳۱
دستورات عمومی	۳۲
HELP	۳۳
دستور FINDIT	۳۴
منابع پیشنهادی برای مطالعه بیشتر	۳۶
فصل سوم: مدل‌های عمومی داده‌های ترکیبی	۳۷
مدل عمومی داده‌های ترکیبی و انواع آن	۳۹
مدل اثر ثابت	۴۲
مدلی با شیب رگرسیون ثابت	۴۳

۴۵	مدل با شیب رگرسیون های متغیر
۴۵	مدل آثار تصادفی
۴۶	انتخاب مدل
۴۶	آزمون چاو
۴۷	آزمون بروش - پاگان
۴۸	آزمون هاسمن
۴۹	مدل رگرسیون های به ظاهر نامرتبط با شیب رگرسیون های متغیر
۵۱	آزمایش های تشخیصی
۵۷	کار با نرم افزار
۵۷	نحوه انجام آزمون چاو
۶۰	نحوه انجام آزمون هاسمن
۶۳	فصل چهارم: ریشه واحد و هم جمعی در داده های ترکیبی
۶۵	ریشه واحد و هم جمعی
۶۵	ایستایی
۶۶	آزمون های ایستایی
۶۷	آزمون دیکی - فولر و دیکی - فولر تعمیم یافته
۶۹	آزمون فیلیس و پرون
۷۰	هم جمعی
۷۲	مفهوم اقتصادی هم جمعی
۷۳	روش حداکثر درست نمایی (آزمون یوهانسون)
۷۶	آزمون ریشه واحد در داده های ترکیبی
۷۷	آزمون ریشه واحد مشترک داده های ترکیبی
۷۷	آزمون لیوین و لین و چو (LLC)
۷۹	آزمون بریتونگ
۸۰	آزمون هایی دارای فرآیند ریشه واحد جداگانه داده های ترکیبی در میان مقاطع

۸۰	آزمون ایم، پسران و شین
۸۲	آزمون فیشر
۸۴	آزمون LM بر اساس جملات پسماند
۸۸	آزمون‌های ریشه واحد داده‌های ترکیبی در صورت وجود وابستگی مقطعی
۹۱	آزمون‌های هم جمعی داده‌های ترکیبی
۹۴	کار با نرم افزار
۹۴	نحوه انجام آزمون‌های ایستایی
۹۴	ورود داده
۱۰۱	فصل پنجم: روش گشتاورهای تعمیم یافته (GMM)
۱۰۳	روش گشتاورهای تعمیم یافته (GMM)
۱۰۵	به کارگیری روش GMM برای مدل داده‌های ترکیبی پویا
۱۱۰	کار با نرم افزار
۱۱۸	منابع پیشنهادی برای مطالعه بیشتر
۱۱۹	فصل ششم: انجام یک کار تجربی
۱۲۱	طرح یک سوال
۱۲۸	مرور ادبیات موضوع
۱۳۰	جمع آوری داده‌ها
۱۳۳	وارد کردن و ذخیره سازی داده‌های تحقیق
۱۳۷	نظارت، پاکسازی و خلاصه سازی داده‌ها
۱۴۰	تجزیه و تحلیل اقتصادسنجی
۱۴۹	نگارش یک مقاله تجربی
۱۴۹	مقدمه
۱۵۱	چارچوب نظری
۱۵۲	مدل‌های اقتصادسنجی و روشهای برآورد

۱۵۵	 داده‌ها
۱۵۶	 نتایج
۱۵۹	 نتیجه‌گیری
۱۵۹	 نکاتی در مورد شکل ظاهری یک مقاله
۱۶۰	 ارجاع دهی
۱۶۱	 نظام استناد نویسنده - تاریخ
۱۶۱	 منابع و رد استناد
۱۶۲	 روش شیکاگو
۱۶۳	 مثال‌هایی ارجاء دهی منابع فارسی به روش شیکاگو
۱۶۴	 ارجاع دهی منبع لاین به روش شیکاگو
۱۶۵	 روش APA
۱۶۹	 منابع و مآخذ

مقدمه نویسندگان

هدف اصلی این کتاب ارائه یک راهنمای گام به گام برای اقتصادسنجی کاربردی با رویکرد داده‌های ترکیبی، با استفاده از بسته نرم‌افزاری استاتا نسخه ۱۳ است. این مجموعه حاوی مروری مختصر بر مفاهیم اقتصادسنجی، مدل‌ها و تکنیک‌های تجزیه و تحلیل داده در داده‌های ترکیبی یا پانل دیتا است که به دنبال آن مثال‌های عملی درباره چگونگی انجام آن‌ها در نرم‌افزار استاتا ۱۳ آمده است. استاتا یک نرم‌افزار یک‌پارچه و چند منظوره تجزیه و تحلیل داده‌های آماری است که تمامی نیازهای کاربر با تجزیه و تحلیل، مدیریت و نمایش گرافیکی داده‌های آماری فراهم می‌کند. استاتا یکی از بهترین نرم‌افزارهای آماری است که قابل استفاده برای رشته‌های محاسباتی و اقتصاد، جامعه‌شناسی، علوم سیاسی و نیز بعضی از شاخه‌های علوم پزشکی است. با توجه به اهمیت داده‌های ترکیبی، محققان می‌توانند از داده‌های ترکیبی برای مواردی که مسائل را نمی‌توان صرفاً به صورت سری زمانی یا برش‌های مقطعی بررسی کرد، بهره‌گیرند. مثلاً در بررسی تابع تولید مساله‌ای که وجود دارد این است که به تنهایی تغییرات تکنولوژیک را از صرفه‌های به مقیاس تفکیک کرد. در این گونه موارد داده‌های مقطعی فقط اطلاعاتی را در مورد صرفه‌های به مقیاس فراهم می‌آورد. در حالی که داده‌های سری زمانی اثرات هردو را بدون هیچ گونه تفکیکی نشان می‌دهد. تلفیق داده‌های سری زمانی با داده‌های مقطعی نه تنها می‌تواند اطلاعات سودمندی را برای تخمین مدل‌های اقتصادسنجی فراهم آورد، بلکه بر مبنای نتایج به دست آمده می‌توان استنباط‌های سیاست‌گذاری درخور توجهی نیز به عمل آورد. این کتاب با

رویکردی کاربردی در حوزه اقتصادسنجی مطالعات ترکیبی مدل‌های اثرات ثابت و تصادفی، ریشه واحد در داده‌های ترکیبی، روش پانل ایستا و پویا و نحوه نگارش یک مقاله تجربی را مورد بحث و بررسی قرار می‌دهد.

در پایان از تمامی خوانندگان گرامی خواهشمندیم که ما را از راهنمایی‌ها و نظرات سازنده خود بی‌نسیب نکنند و ما را در انتشار بازبینی صحیح و مؤثر از این کتاب یاری رسانند. برای ارتباط با نویسندگان کتاب با پست الکترونیک Hfrazmand@ecu.ac.ir و Ebs1365@gmail.com مکاتبه فرمایید.

امید است یاری خداوند متعال، این کتاب زمینه را برای رشد استعدادها و تقویت توانمندی‌ها را از دگان علاقه‌مند به نرم‌افزار استاتا را فراهم کند.

حسن فرازمند - صلاح ابراهیمی