

اقتصاد سنجی

نظریه و کاربرد آن با EVIEWS

نویسنده: بن وگل ونگ

ترجمه:

دکتر زهرا شیدائی

دکتر محمدنبی شهیکی تاش

دانشیار اقتصاد دانشگاه سیستان و بلوچستان

سرشناسه	وگل ونگ، بن، (Vogelvong, Ben)
عنوان و پدیدآور	اقتصادسنجی نظریه و کاربرد آن با EViews / نویسنده: بن وگل ونگ - ترجمه: دکتر زهرا شیدانی، دکتر محمدنبی شهیکی تاش
مشخصات نشر	تهران، نور علم.
مشخصات ظاهری	۵۰۳ ص. نمودار، جدول.
عنوان انگلیسی	Econometrics Theory and Applications with EViews
شابک	۹۷۸-۶۰۰-۱۶۹-۳۷۷-۹
موضوع	اقتصادسنجی - برنامه‌های کامپیوتری
موضوع	نرم افزار ایویوز
موضوع	اقتصادسنجی - نرم افزار
شماره افزوده	شیدانی، زهرا، ۱۳۶۳ - مترجم.
شماره افزوده	شهیکی تاش، محمدنبی، ۱۳۵۹ - مترجم
سهم بندی کنگره	۷/۹۰ الف / HB ۱۴۱
ردیف دیویی	۳۳۰/۰۱۵

نشر نور علم: تهران - خیابان - خ وحید نظری - کوچه فرزانه - تلفن: ۶۶۴۰۵۸۸۰ و ۶۶۴۰۵۸۹۴
 فروشگاه: دانشکده اقتصاد دانشگاه تهران ۰۹۱۲۳۳۳۴۲۲۲ noralm@yahoo.com

عنوان کتاب: اقتصادسنجی نظریه و کاربرد آن با EViews

نویسنده: بن وگل ونگ

مترجم: دکتر زهرا شیدانی، دکتر محمدنبی شهیکی تاش

ناشر: نور علم

شمارگان: ۵۰۰ جلد

شابک: ۹۷۸-۶۰۰-۱۶۹-۳۷۷-۹

نوبت چاپ: اول ۱۳۹۹

چاپ و صحافی: نصر

قیمت: ۹۵۰۰۰ تومان

در صورت عدم دسترسی به کتابهای این انتشارات، از طریق تماس با
 09123334229 کتابها با پست به تمام نقاط ایران ارسال می شود.

فهرست

۱۱.....	پیشگفتار مترجم
۱۳.....	بخش ۱
۱۳.....	بخش مقدماتی
۱۳.....	مقدمه
۱۵.....	فصل اول
۱۵.....	مفاهیم اصلی مدل های اقتصادسنجی
۱۵.....	۱-۱. تحقیقات کمی در اقتصاد
۱۶.....	۱-۲. مدل های آمادسنجی و اقتصادی
۱۹.....	۱-۳. داده های اقتصادی
۲۰.....	۱-۴. متغیرهای مدل اقتصاد
۲۱.....	مثال ۱-۱: یک مدل کلان ده کتبی
۲۲.....	مثال ۲-۱: مدلی برای مصرف بهره در یک کشور
۲۴.....	نکته ۱-۱: هشدار
۲۵.....	نکته ۲-۱: آیا مشخصات معادله مصرف بهره واقع بهانه است؟
۲۵.....	۱-۵. معادلات ساختاری و خلاصه شده
۲۶.....	۱-۶. پارامترها و کشش ها
۲۹.....	نتیجه گیری
۲۹.....	۱-۷. مدل های تصادفی
۳۰.....	۱-۸. تحقیقات اقتصادی کمی کاربردی
۳۵.....	فصل ۲
۳۵.....	شرح مجموعه داده ها و معرفی موارد
۳۵.....	۲-۱. مقدمه
۳۶.....	۲-۲. مجموعه داده ۱: قیمت کالاها
۳۷.....	۲-۳. مجموعه داده ۲: داده های کلان اقتصادی
۴۰.....	۲-۴. مجموعه داده ۳: داده های مربوط به بازار نفت
۴۲.....	۵.۲. مجموعه داده ۴: بازار پول
۴۳.....	۶.۲. مجموعه داده ۵: داده های مقطعی

فصل ۳.....	۴۵
مفاهیم اصلی Eviews و شروع پروژه تحقیق.....	۴۵
۳-۱. مقدمه.....	۴۵
۳-۲. ایجاد یک فایل کاری در Eviews.....	۴۶
۳-۳. مشاهده متغیرها و برخی روش ها.....	۵۴
۳-۴. برخی محاسبات پایه در Eviews.....	۶۹
۳-۵. بخش ۱ تجزیه و تحلیل داده.....	۷۷
تمرین ۱- شروع پروژه تحقیقی.....	۷۷
بخش دوم.....	۷۹
مدل فرم خلاصه شده.....	۷۹
مقدمه.....	۷۹
فصل ۴.....	۸۱
شرح مدل فرم خلاصه شده.....	۸۱
۴-۱. مقدمه.....	۸۱
۴-۲. فروض مدل رگرسیون کلاسیک.....	۸۳
۴-۳. تخمین زن حداقل مربعات معمولی (OLS).....	۸۸
۴-۴. رابطه بین اخلال ها و پسماندها.....	۹۴
۴-۵. تخمین واریانس جزء اخلال.....	۹۷
۴-۶. ویژگی های آماری مطلوب تخمین زن ها.....	۹۹
مثال ۴-۱: میانگین نمونه به عنوان تخمین زن متوسط جامعه.....	۱۰۳
۴-۷. توزیع و برخی خواص تخمینزن OLS.....	۱۰۳
نکته ۴-۱: اشتباه در محاسبات خطاهای معیار.....	۱۰۹
مثال ۴-۲: متغیرهای توضیحی برونزا (مدل رگرسیون کلاسیک).....	۱۱۵
مثال ۴-۳: یک متغیر توضیحی وابسته با وقفه (مدل فرم خلاصه شده).....	۱۱۵
مثال ۴-۴: یک متغیر توضیحی درونزا (مدل شکل ساختاری).....	۱۱۷
۴-۸. تخمین حداکثر راست نمایی.....	۱۲۰
۴-۹. تجزیه و تحلیل رگرسیون با Eviews.....	۱۲۲
فصل ۵.....	۱۲۷

آزمون فروض قطعی	۱۲۷
۵-۱. مقدمه	۱۲۷
۵-۲. رابطه بین متغیرها در مدل خطی	۱۲۸
۵-۳. ضریب تعیین	۱۳۲
۵-۴. مطالعه برخی توزیعات مفید و اصول آزمون	۱۳۷
۵-۵. توزیع تخمین زن واریانس پسماند	۱۴۲
۵-۶. تخمین فاصل های و آزمون t برای آزمون محدودیت روی پارامترها	۱۴۳
نکته ۱-۱. آزمون کشش	۱۴۷
نکته ۲-۲. عروضات اساسی	۱۴۷
نکته ۳-۳. احتمالاً، در بوا های یک دنباله و دو دنباله	۱۴۷
نکته ۴-۴. متغیر ای و ایسته باقیه	۱۴۸
تذکر ۵-۵: نمادی برابر تغییر اختلاف	۱۵۲
۵-۷. آزمون F والد برای آزمون محدودیت روی پارامترها	۱۵۳
مثال ۴-۴: آزمون شیب های صفر	۱۵۵
مثال ۵-۵: آزمون یک محدودیت با EVIEWS	۱۵۶
نکته ۶-۵: رابطه میان آزمون t و F در مورد یک محدودیت	۱۵۹
۵-۸. عبارات جایگزین برای آزمون F والد و آزمون LMI	۱۵۹
نکته ۷-۵: ضریب تعیین	۱۶۲
مثال ۵-۶: مثال های محاسباتی	۱۶۲
نکته ۸-۵: عبارت های دیگر برای آماره ها	۱۶۳
فصل ۶	۱۶۵
آزمون فروض تصادفی و پایداری مدل	۱۶۵
۶-۱. مقدمه	۱۶۵
۶-۲. آزمون نرمالیتی	۱۶۸
۶-۳. آزمون های خودهمبستگی پسماند	۱۷۲
۶-۴. آزمون هایی برای ناهمسانی واریانس	۱۸۳
۶-۵. بررسی پایداری پارامتر	۱۹۴
۶-۶. تخمین مدل و ارائه نتایج تخمین	۱۹۸

۶-۷. تمرین ۲: مدل اقتصادسنجی برای داده های سری زمانی	۲۰۲
فصل هفتم	۲۰۵
مجموعه مباحث درباره مدل خطی	۲۰۵
۷-۱. مقدمه	۲۰۵
۷-۲. خطاهای تصریح	۲۰۵
۷-۳. پیشینی	۲۱۰
۷-۴. همبستگی	۲۲۶
۷-۵. تغییراتی توضیحی ساختگی	۲۳۱
۷-۶. تمرین ۳: تمرینی با مدل برآورد شده	۲۴۰
بخش ۳	۲۴۳
مدل های ساختاری خاص	۲۴۳
مقدمه	۲۴۴
فصل ۸	۲۴۷
تخمین با فروض جزء اخلاص عمومی تر	۲۴۷
۸-۱. مقدمه	۲۴۷
۸-۲. تخمین زن حداقل مربعات تعمیم یافته (GLS) به صورت تئوری	۲۴۹
۸-۳. مدل رگرسیون های به ظاهر غیر مرتبط (SUR)	۲۵۱
تذکره ۸-۱:	۲۵۵
۸-۴. مورد ۴: مدل SUR برای داده های کلان اقتصادی	۲۵۸
۸-۵. اخلاص های خودهمبسته	۲۵۹
۸-۶. ناهمسانی واریانس اخلاص ها	۲۶۳
مثال ۸-۱: حداقل مربعات وزنی	۲۷۱
۸-۷. تمرین ۴: ناهمسانی واریانس اخلاص ها	۲۷۸
۸-۸. معرفی مدل های ARCH و GARCH	۲۷۹
فصل ۹	۲۸۹
مدل هایی با متغیرهای توضیحی درونزا	۲۸۹
۹-۱. مقدمه	۲۸۹
۹-۲. تخمین زن متغیر ابزار (IV)	۲۹۲

مثال ۹-۱: یک مدل معادله همزمان ساده	۲۹۴
۹-۳ تخمین زن حداقل مربعات دو مرحله ای (2SLS)	۲۹۶
تذکر ۹-۱:	۳۰۱
۹-۴ تخمین 2SLS و IV با EViews	۳۰۴
۹-۵ تمرین ۵: تخمین سازگار مدل های ساختاری	۳۰۷
فصل ۱۰	۳۰۹
مدل های معادلات همزمان	۳۰۹
۱۰-۱ مقدمه	۳۰۹
۱۰-۲ نمودارهای SEM	۳۱۰
مثال ۱۰-۱: یک مدل اقتصاد کلان	۳۱۴
۱۰-۳ شناسایی	۳۱۷
مثال ۱۰-۲: شرط رتبه ای	۳۲۲
۱۰-۴ تمرین ۶: شناسایی معادلات SEM	۳۲۴
۱۰-۵ روش های تخمین	۳۲۵
۱۰-۶ تمرین ۷: تخمین یک مدل اقتصاد کلان همزمان	۳۲۸
۱۰-۷ دو مدل معادله مرکب خاص	۳۲۹
فصل ۱۱	۳۳۵
متغیرهای وابسته کیفی	۳۳۵
۱۱-۱ مقدمه	۳۳۵
۱۱-۲ مدل احتمال خطی	۳۳۷
تذکر ۱۱-۱: تابع تبعیض خطی	۳۴۰
۱۱-۳ مدل های Logit و Probit	۳۴۱
۱۱-۴ تخمین مدل با متغیر وابسته دو گانه با Eviews	۳۴۵
شکل ۱۱-۶: مدل لاجیت تخمین زده شده	۳۵۰
۱۱-۵ تمرین ۸: مدل سازی یک متغیر وابسته کیفی	۳۵۳
بخش ۴	۳۵۵
مدل های سری زمانی	۳۵۵
مقدمه بخش ۴	۳۵۶

۳۵۷	فصل ۱۲
۳۵۷	مدل های پویا، ریشه واحد و همانباشتگی
۳۵۷	۱.۱۲. مقدمه
۳۵۹	۱۲-۲. عملگرهای وقفه ای، نماد و مثال ها
۳۶۶	۱۲-۳. اثرات بلندمدت مدل های پویای کوتاه مدت
۳۶۹	مثال ۱۲-۱: یک مدل اقتصاد کلان
۳۷۱	مثال ۱۲-۲: تابع مصرف اقتصاد کلان
۳۷۲	۱۲-۴. مدل های تصحیح خطا
۳۸۹	۱۲-۵. آزمون های ریشه واحد
۴۱۰	تذکر ۱۲-۱: آزمون های ریشه واحد و مدل های تصادفی
۴۱۰	۱۲-۶. روابط بین متغیرهای آماتنا
۴۲۰	نکته ۱۲-۲: روش
۴۲۰	نکته ۱۲-۳: تصریح
۴۲۰	مثال ۱۲-۳: تجزیه و تحلیل همانباشتگی
۴۲۷	۱۲-۷. تمرین ۹: تجزیه و تحلیل همانباشتگی
۴۲۹	فصل ۱۳
۴۲۹	مدل های توزیعی وقفه ای
۴۲۹	۱۳-۱. مقدمه
۴۳۰	۱۳-۲. مدل توزیعی با وقفه محدود
۴۳۸	۱۳-۳. وقفه های توزیعی نامحدود
۴۴۴	نکته ۱۳-۱:
۴۴۴	۱۳-۴. مدل هایی با متغیر وابسته وقفه ای
۴۵۱	فصل ۱۴
۴۵۱	مدل های سری زمانی تک متغیره
۴۵۱	۱۴-۱. مقدمه
۴۵۵	۱۴-۲. مدل های سری زمانی و برخی ویژگی ها
۴۶۰	۱۴-۳. روش های باکس-جنکینز
۴۶۳	۱۴-۴. تابع خودهمبستگی (ACF)

پیشگفتار مترجم

اقتصادسنجی بیان مقداری صحت و سقم نظریات در اقتصاد است. این رشته به دلیل سنجش مقداری نظریات اقتصادی، اهمیت زیادی دارد؛ در واقع اقتصادسنجی به دنبال تصویر آماری از نظریات اقتصادی است. راگنار فریش، اقتصاددان و آمارشناس نروژی برای اولین بار اصطلاح "اقتصادسنجی" را در سال ۱۹۳۶ مورد استفاده قرار داد. اقتصادسنجی به تحلیل کلی و انتزاعی پدیده های اقتصادی بسنده نمی کند و به بررسی این پدیده ها با استفاده از روش های آماری می پردازد. از این روی در بسیاری از مطالعات تجربی برای انجام اموری همچون پیش بینی و کمک به سیاست گذاری بکار گرفته می شود. اهمیت روش های اقتصادسنجی به اندازه ای است که برخی آن را جزء جدا ناشدنی تحلیل های اقتصادی دانسته اند. لازمه به ذکر است که اگرچه این علم به طور سنتی در مورد موضوعات اقتصاد کلان بکار گرفته می شده اما امروز اقتصادسنجی در سایر حوزه های اقتصاد مثل اقتصاد خرد، اقتصاد توسعه، اقتصاد بهداشت، اقتصاد پولی و مالی، اقتصاد شهری و منطقه ای و ... به عنوان یک ابزار قوی جهت آزمون نظریه ها بکار گرفته می شود.

از ویژگی های بارز این شاخه از علم اقتصاد تحولات سریع و شگرف آن در طول زمان و بویژه طی دهه های گذشته می باشد. اهمیت این موضوع زمانی و چندان می شود که روش ها و شیوه های جدید، روش های گذشته را اصلاح، تکمیل و یا نقض می کنند. دیگر ویژگی اقتصادسنجی آن است که نه به عنوان ابزاری انتزاعی، بلکه به عنوان ابزاری کاربردی در علم اقتصاد شناخته می شود. براین اساس آنچه در بکارگیری این ابزار حایز اهمیت است، علاوه بر شناسایی چندین نظری مربوط به روش های مختلف، توانایی تلفیق این ابزار کمی با نظریه های اقتصادی است.

بطور خلاصه، اهداف اقتصادسنجی را به طور کلی می توان دادن محتوای تجربی، روابط اقتصادی برای آزمودن نظریه های اقتصادی، پیش بینی، تصمیم گیری، و ارزیابی پیشینی یک سیاست گذاری یا تصمیم دانست.

در این کتاب که محصول تجربه بن وگولونگ می باشد، نگارنده بخوبی توانسته با ادبیاتی مناسب به مبانی نظری تکنیک ها اشاره نموده و نحوه استفاده کاربردی این مباحث را در نرم افزار EVIEWS نشان دهد. امیدوارم این کتاب ارزنده بتواند در توسعه دانش کاربردی حوزه اقتصاد مفید باشد.