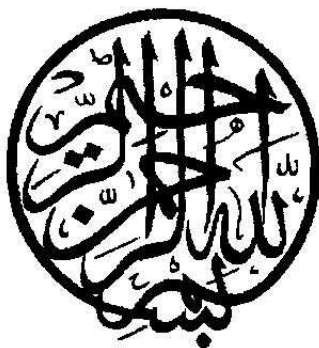




اقتصاد سنجی پیشرفته

تألیف:

پیمان کاظمی

دانش آموخته رشته اقتصاد دانشگاه شهید بهشتی تهران

۱۳۹۹

سرشناسه	: کیانی، پیمان، ۱۳۷۰ -
عنوان و نام پدیدآور	: اقتصادسنجی پیشرفته / پیمان کیانی.
مشخصات نشر	: همدان: فراگیران سینا، ۱۳۹۹.
مشخصات ظاهری	: ۱۰۳ ص.
شابک	: ۹۸۷-۶۰۰-۷۷۸۰-۷۲-۵
وضعیت فهرست‌نویسی	: فیپا
یادداشت	: کتابنامه.
موضوع	: اقتصادسنجی -- روش‌های آماری
موضوع	: Econometrics -- Statistical methods :
شناسه افزود	: کیان‌پور، سعید، ۱۳۶۳ -، ویراستار
رده بندی - ننگ	: HB ۱۳۹ :
رده بندی - یوبی	: ۳۳۰/۰۱۵۱۹۵ :
شماره کتابشناسی	: ۶۱۳۲۷۲۰ :



عنوان کتاب:	اقتصادسنجی پیشرفته
مؤلف:	پیمان کیانی
ویراستار علمی:	سعید کیانی پور (عضو هیات علمی گروه اقتصاد دانشگاه پیام نور)
طراح آموزشی:	دکتر محمد میری (عضو هیات علمی دانشگاه ملی ملایر)
ناشر:	انتشارات فراگیران سینا
چاپ:	سینا
شمارگان:	۱۰۰۰ جلد
نوبت چاپ:	اول / ۱۳۹۹
شابک:	۹۷۸-۶۰۰-۷۷۸۰-۷۲-۵
قیمت:	۳۰,۰۰۰ تومان

مرکز پخش: همدان، خیابان شریعتی، مقابل کبابیان، کوچه مهر
 تلفن: ۰۸۱-۳۲۵۱۴۴۶۱-۳۲۵۱۶۱۴۴-۳۲۵۲۸۴۶۲-۰۸۱ دورنگار: ۰۸۱-۳۲۵۱۷۲۵۲

اقتصاد سنجی چیزی نیست جز به کاربردن آزمون‌ها و روش‌های علم آمار در حوزه علم اقتصاد. تمامی آزمون‌ها، روش‌ها و تحلیل‌های اقتصاد سنجی برگرفته از علم آمار می‌باشد. و البته می‌باید اذعان کرد که متخصصین اقتصاد سنجی به خوبی توانسته‌اند روش‌های آماری را برای تحلیل مسائل اقتصادی به خدمت بگیرند و در این مسیر تلاش زیادی نموده‌اند. به گونه‌ای که هم اکنون یک متخصص اقتصاد سنجی به دلیل تدریسی که بر مبحث رگرسیون داشته است، از یک متخصص علم آمار، رگرسیون را بهتر می‌شناسد و برای برآورد مدل رگرسیونی روی داده‌های اقتصادی کار خود را به خوبی انجام می‌دهد. بنابراین یک متخصص آمار اگر بخواهد در حوزه اقتصاد سنجی کار و فعالیت نماید، لازم است نکات و آموزش‌های تکمیلی در این خصوص را دریافت کند تا بتواند در حوزه تحلیل داده‌های اقتصادی فعالیت نماید. این کاری است که تحلیلگران تجربه اقتصادی در شرکت آماری اطمینان شرق انجام داده‌اند، یعنی تلفیق درست و اصولی علم آمار و اقتصاد برای تحلیل داده‌های اقتصادی، با شناختی قابل قبول از اقتصاد. از این رو در این کتاب به تبیین مباحث اقتصاد سنجی در ورای یادگیری عملی خواهیم آمد.

پیمان کیانی

دانش آموخته کارشناسی ارشد اقتصاد نظری دانشگاه شهید بهشتی تهران

فهرست

۱- مقدمه	۹
۲- فرآیند تولید دبی ساکن (ایستا)	۹
۳- آزمون ساکن بودن برای نمودار همبستگی	۱۰
۴- مدل‌های سری زمانی	۱۴
۴-۱- روش‌های پیش‌بینی اقتصادی	۱۴
۴-۲- مدل‌سازی AR, MA و RIM برای داده‌های سری زمانی	۱۶
۴-۲-۱- (AR)	۱۶
۴-۲-۲- (MA)	۱۷
۴-۲-۳- (ARMA)	۱۸
۴-۲-۴- (ARIMA)	۱۸
۵- متدولوژی باکس-جنکینز	۱۹
۵-۱- تشخیص:	۲۱
۵-۲- تخمین مدل	۲۴
۵-۳- کنترل تشخیصی:	۲۴
۵-۴- پیش‌بینی:	۲۴
۶- آزمون ریشه واحد: آزمون‌های ایستا بودن	۲۸

- ۳۲ ۱-۶- ریشه واحد
- ۳۴ ۱-۱-۶- آزمون دیکی فولر (DF)
- ۳۴ ۱-۱-۱-۶- مونته- کارلو
- ۳۶ ۲-۱-۶- آزمون فیلیس- پرون PP
- ۳۷ ۳-۱-۶- آزمون پرون همراه با شکست ساختاری
- ۳۸ ۷- فرایند استوکاستیک روند - ایستا (TS) و تفاضل - ایستا (DS)
- ۴۱ ۸- رگرسیون ساختاری
- ۴۲ ۹- هم انباشتگی (مکرای)
- ۴۴ ۱-۹- آزمون انگل- گرنجر- انگل گرنجر تعمیم یافته:
- ۴۴ ۲-۹- آزمون دورین واتسون (CDW)
- ۴۵ ۳-۹- آزمون یوهانسن و یوسلیوس
- ۴۷ ۱۰- مدل تصحیح خطا
- ۴۸ ۱۱- مدل Arch
- ۵۰ ۱۲- مدل GARCH
- ۵۱ ۱۳- مدل IGARCH
- ۵۱ ۱۴- مدل EGARCH
- ۵۱ ۱۵- مدل TGARCH
- ۵۵ ۱- خود رگرسیون برداری (VAR):
- ۵۵ ۱-۱- مدل ساختاری VAR:
- ۵۶ ۲- تابع عکس العمل آنی (ضریبهای) IRF:
- ۵۸ ۳- رتبه بندی
- ۵۹ ۴- تجزیه واریانس (VD):

- ۵- آزمون علیت گرنجری ۶۰
- ۶- برخی از مشکلات مدل سازی VAR: ۶۲
- ۶-۱ طرفداران مدل VAR بر ویژگی هایی از این روش تأکید دارند و آن ها عبارتند از: ۶۲
- ۶-۲ اما منتقدین روش مدل سازی VAR مشکلات این روش را این چنین بیان می کنند: ۶۲
- ۷- معیار اطلاعاتی برای تعیین طول وقفه var ۶۳
- ۸- الگوی مورد توضیح برداری و هم انباشتگی با روش جوهانسن ۶۴
- ۱- داده های ترکیبی ۶۹
- ۱-۱ مزیت استفاده از داده های ترکیبی نسبت به داده های مقطعی و سری زمانی ۶۹
- ۲- روش های تخمین ۷۱
- ۳- مراحل تخمین مدل با استفاده از داده های ترکیبی ۷۲
- ۴- اثرات ثابت ۷۴
- ۵- اثرات تصادفی ۷۶
- ۶- آزمون هاسمن ۷۸
- ۶-۱ هاسمن ۸۰
- ۱- مقدمه ۸۲
- ۲- مدل های خود رگرسیون و وقفه توزیعی ۸۲
- ۲-۱-۱ علل وجود وقفه: ۸۲
- ۲-۱-۲ علل روانی ۸۳
- ۲-۱-۲-۱ علل تکنولوژیکی ۸۳
- ۲-۱-۲-۳ علل نهادی ۸۴
- ۲-۲ کاربرد وقفه در اقتصاد ۸۴
- ۳- مدل دینامیکی ۸۶

- ۳-۱- تأخیرات زمانی توزیعی ۸۶
- ۳-۲- تبدیل کوپک ۸۷
- ۳-۳- فرضیه تعدیلات جزئی ۹۱
- ۳-۴- فرضیه انتظارات انطباقی ۹۳
- ۳-۶- چند جمله ای تأخیری المون ۹۷

www.ketab.ir