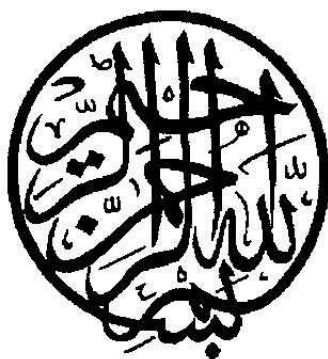




مبانی اقتصاد سنجی و گرسیونی

تألیف:

پیمان کیانی

دانش آموخته رشته اقتصاد دانشگاه شهید بهشتی، تهران

۱۳۹۹

سرشناسه	: کیانی، پیمان، ۱۳۷۰ -
عنوان و نام پدیدآور	: مبانی اقتصادسنجی رگرسیونی / پیمان کیانی.
مشخصات نشر	: همدان: فراگیران سینا، ۱۳۹۹.
مشخصات ظاهری	: ۱۰۳ ص.
شابک	: ۹۸۷-۶۰۰-۷۷۸۰-۷۳-۲
وضعیت فهرست‌نویسی	: فیپا
یادداشت	: کتابنامه.
موضوع	: اقتصادسنجی -- روش‌های آماری
موضوع	: Econometrics -- Statistical methods
شناسه افزود	: کیان‌پور، سعید، ۱۳۶۳ - ویراستار
رده بندی کنگره	: HB ۱۳۹
رده بندی دربی	: ۳۳۰/۰۱۵۱۹۵
شماره کتابشناسی ملی	: ۶۱۳۲۷۲۱



عنوان کتاب:	مبانی اقتصادسنجی رگرسیونی
مولف:	پیمان کیانی
ویراستار علمی:	سعید کیان (عضو هیات علمی گروه اقتصاد دانشگاه پیام نور)
طراح آموزشی:	دکتر محمدرضا ری (عضو هیات علمی دانشگاه ملی ملایر)
ناشر:	انتشارات فراگیران سینا
چاپ:	سینا
شمارگان:	۱۰۰۰ جلد
نوبت چاپ:	اول / ۱۳۹۹
شابک:	۹۷۸-۶۰۰-۷۷۸۰-۷۳-۲
قیمت:	۳۰,۰۰۰ تومان

مرکز پخش: همدان، خیابان شریعتی، مقابل کبابیان، کوچه مهر

تلفن: ۳۲۵۱۴۴۶۱-۳۲۵۱۶۱۴۴-۳۲۵۲۸۴۶۲-۰۸۱ دورنگار: ۳۲۵۱۷۲۵۲-۰۸۱

راگنار فریش، اقتصاددان و آمارشناس نروژی برای اولین بار اصطلاح «اقتصادسنجی» را در 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. لازم به ذکر است که اگرچه این علم به طور سنتی در مورد موضوعات اقتصاد کلان بکار گرفته می شد ولی امروزه اقتصادسنجی در سایر حوزه های اقتصاد مثل اقتصاد خرد، اقتصاد توسعه، اقتصاد بهداشت، اقتصاد پول، اقتصاد شهری و منطقه ای و ... به عنوان یک ابزار قوی جهت آزمون نظریه بکار گرفته می شود. اقتصاددانان مانند سایر دانشمندان علوم اجتماعی نمی توانند شرایط را تحت کنترل خود بر آورند و داده های مورد نیازشان را تولید کنند. از طرف دیگر اقتصادسنج به مجموعه ای غنی از نظریه های اقتصادی استرسی دارد در نتیجه وظیفه ی روش اقتصادسنجی این است که ابزاری را ارائه دهد که توسط آن اطلاعات زیرمونه ای بتوانند به منظور ساخت یک مدل مورد استفاده قرار گیرد. وقتی مدل های اقتصادسنجی به طور صریح مشخص می شوند، نظریه های آماری، ابزار و وسایل تخمین های فاصله ای و نقطه ای پارامترهای مورد بررسی در دسترس قرار می گیرد. از راه های ارزیابی عملکرد آن قوانین را آزمون می کنند. از ویژگی های بارز این شاخه از علم اقتصاد (که امکان تجزیه و تحلیل های کمی را فراهم می آورد) تحولات سریع و شگرف آن در طول زمان و بویژه طی دهه های گذشته می باشد. اهمیت این موضوع زمانی دو چندان می شود که روش ها و شیوه های جدید، روش های کلاسیک را اصلاح، تکمیل و یا نقض می کنند، از این روی عدم آشنایی با ابزارهای جدید در این حوزه می تواند به تحلیل های گمراه کننده ای منتج شود. دیگر ویژگی اقتصادسنجی آن است که نه به عنوان ابزاری انتزاعی بلکه به عنوان ابزاری انتزاعی در علم اقتصاد شناخته می شود. براین اساس آنچه در بکارگیری این ابزار حایز اهمیت است، علاوه بر شناسایی جنبه های نظری مربوط به روش های مختلف، توانایی تلفیق این ابزار کمی با نظریه های اقتصادی است.

پیمان کیانی

دانش آموخته کارشناسی ارشد اقتصاد نظری دانشگاه شهید بهشتی تهران

فهرست

۸	۱- ماتریس قسمت بندی (افراز) شده
۱۲	۲- مشتقات ماتریسی
۱۴	۳- ریشه ها و مدارهای مشخصه
۱۹	۴- مفاهیم و تخمین مدل رگرسیون خطی
۲۰	۵- حداقل مربعات معمولی (OLS):
۲۲	۶- نحوه بدست آوردن S از لریق انحراف از میانگین
۲۲	۷- ضرب تعیین
۲۳	۸- خطای معیار تخمین (SEE)
۲۷	۹- خصوصیات آماری α و β
۳۲	۱۰- تغییر مقیاس در متغیرها
۳۳	۱۱- تبدیل مدل غیرخطی به خطی
۳۵	۱۲- پیش بینی متغیر دورن زا در مدل رگرسیون ساده بر حسب متغیر برون زا
۳۸	۱۳- رگرسیون دو متغیر
۳۹	۱- مقدمه
۳۹	۲- حداقل مربعات معمولی (OLS)
۴۰	۱-۲- خواص خط رگرسیون OLS
۴۲	۲-۲- تفسیر هندسی OLS
۴۵	۲-۳- فروض استاندارد کلاسیک
۴۶	۲-۴- محاسبه واریانس و کواریانس تخمین زن ها

۴۸	۵-۲- قضیه گوس مارکف.....
۴۸	۵-۲-۱- خطی بودن:.....
۴۹	۵-۲-۲- نا اریب بودن:.....
۴۹	۵-۲-۳- حداقل واریانس داشتن:.....
۵۵	۱- مقدمه.....
۶۲	۲- تخمین زنند میانگین مجذور خطا.....
۶۳	۳- برآورد σ^2
۶۴	۳-۱- مقایسه MLE با σ^2 تخمین زن ها در مورد برآورد پارامتر.....
۶۴	۳-۲- برآورد واریانس در روش رگرسیونی.....
۶۵	۳-۲-۱- در مورد میانگین σ^2
۶۵	۳-۲-۲- در مورد واریانس-کواریانس، σ^2 ها.....
۷۰	۱- مقدمه.....
۷۰	۲- استنتاج آماری به طور ماتریسی.....
۷۴	۳- توزیع نرمال.....
۷۶	۴- توزیع مربع کای دو.....
۷۷	۵- توزیع تی.....
۷۸	۶- توزیع اف (فیشر).....
۷۹	۷- توزیع های t و F مورد نظر در استنتاج آماری.....
۸۴	۸- آزمون فرضیه.....
۸۴	۸-۱- آزمون فرضیه ها تکی راجع به پارامترها.....
۸۵	۸-۲- آزمون چندین فرضیه به طور توأم.....

۸۵ ۹- آزمون F اقتصادسنجی به عنوان حالت خاص F ماتریسی بالا

۸۶ ۹-۱ F آنالیز واریانس جهت آزمون معنی داری کلی رگرسیون

۸۷ ۹-۲ F آزمون قید (Restricted F-Test)

۹۰ ۹-۳ آزمون F ورود متغیر جدید

۹۱ ۱۰- فاصله اعتماد

۹۴ ۱۱- سه آزمون مرتبط به هم :

www.ketab.ir