

کاربرد نرم افزارهای ایویوز، میکروفیت و متلب در اقتصاد سنجی

دکتر ویدا ورهرامی

استادیار دانشگاه شهید بهشتی

انتشارات راز نهان

سرشناسه : ورهرامی، ویدا، ۱۳۶۴
 عنوان و نام پدیدآور : کاربرد نرم افزار های ایویوز، میکروفیت و متلب در اقتصادسنجی / ویدا ورهرامی
 مشخصات نشر : تهران: راز نهان، ۱۳۹۴.
 مشخصات ظاهری : ۱۳۶ ص.
 شابک : 978-600-258-543-1
 وضعیت فهرست : فیبای مختصر
 نویسی :
 یادداشت : فهرست نویسی کامل این اثر در نشانی: <http://opac.nlai.ir> قابل دسترسی است
 شماره کتابشناسی : ۳۷۹۰۴۰۴
 ملی :



نشر راز نهان

عنوان : کاربرد نرم افزار های ایویوز، میکروفیت و متلب در اقتصادسنجی

مولف: ویدا ورهرامی

ناشر: راز نهان

طرح جلد: راز نهان

چاپ: اول ۱۳۹۴

قیمت: ۷۰۰۰ تومان

شمارگان: ۱۰۰۰ نسخه

شابک: ۹۷۸-۶۰۰-۲۵۸-۵۴۳-۱

فصل اول

- ۱-۱ ارائه چند نکته کلیدی در نرم افزار ایویوز..... ۱۱
- ۱-۲ دستور *genr*..... ۱۱
- ۳-۱ مشکلاتی که معمولاً در کار با Eviews با آن مواجه می شویم؟..... ۱۲
- ۴-۱ آزمون خطای تصریح مدل (Ramsey Reset Test)..... ۱۳
- ۵-۱ بحث ثبات یا Stability Test: (آزمون چاو)..... ۱۴

فصل دوم

- ۱.۲ معرفی مدل های *ARMA*..... ۱۵
- ۲.۲ مدل های خود رگرسیون..... ۱۵
- ۳.۲ ساختن یک مدل *AR(1)* در Eviews..... ۱۵
- ۴.۲ مانایی در مدل *AR(P)*..... ۱۶
- ۵.۲ ویژگیهای مدل *AR*..... ۱۷
- ۶.۲ مدل های میانگین متحرک..... ۱۸
- ۷.۲ ویژگی مدل های *MA*..... ۱۸
- ۸.۲ مدل *ARMA*..... ۱۹
- ۹.۲ مدل *BOX-Jenkins*..... ۲۰
- ۱۰.۲ مراحل روش *BOX-Jenkins*..... ۲۱
- ۱۱.۲ کاربرد این مدلها..... ۲۳

فصل سوم

- ۱.۳ مدل های *ARCH-GARCH*..... ۲۶
- ۲.۳ مدل *ARCH*..... ۲۶
- ۳.۳ تخمین مدل *ARCH* در Eviews..... ۲۸
- ۴.۳ مدل *GARCH(P,q)*..... ۲۹
- ۵.۳ تخمین مدل *GARCH* در Eviews..... ۳۰
- ۶.۳ مدل *GARCH-M*..... ۳۱
- ۷.۳ تخمین مدل *GARCH-M* در Eviews..... ۳۲

۳۲.....	۸.۳ مدل TGARCH یا GARCH آستانه ای
۳۳.....	۹.۳ تخمین مدل TGARCH با Eviews
۳۵.....	۱۰.۳ تخمین مدل EGARCH در Eviews
۳۵.....	۱۱.۳ افزودن متغیرهای توضیحی در رابطه با واریانس
۳۶.....	۱۲.۳ کاربرد این مدلها

فصل چهارم

۴۱.....	۱.۴ خود همبستگی
۴۱.....	۲.۴ علل وجود همبستگی
۴۳.....	۳.۴ نتیجه وجود خودهمبستگی بر تخمین های OLS
۴۳.....	۴.۴ اثر خود همبستگی روی ماتریس واریانس - کوواریانس اجزا خطا
۴۴.....	۵.۴ اثر خودهمبستگی روی تخمین OLS در یک رگرسیون چندگانه
۴۵.....	۶.۴ کشف خودهمبستگی
۴۷.....	۷.۴ آزمون Breusch-Godfrey LM برای کشف خودهمبستگی
۴۸.....	۸.۴ آزمون h (در زمانی که متغیرهای وابسته باوقفه هستند)
۴۹.....	۹.۴ مثال آزمون h
۵۰.....	۱۰.۴ رفع مشکل خودهمبستگی
۵۱.....	۱۱.۴ روش تکراری کوکران اورکات
۵۲.....	۱۲.۴ روش هیلدرث لو
۵۲.....	۱۳.۴ آزمون Ramsey Reset
۵۴.....	۱۴.۴ Eviews در RESET Ramsey

فصل پنجم

۵۵.....	۱.۵ واریانس ناهمسانی
۵۶.....	۲.۵ نتیجه واریانس ناهمسانی روی تخمین های OLS
۵۶.....	۳.۵ اثر واریانس ناهمسانی روی تخمین های OLS در مدل رگرسیونی ساده
۵۷.....	۴.۵ اثر واریانس ناهمسانی بر ماتریس واریانس - کوواریانس

۵۸	۵.۵ اثر روی تخمین های OLS در مدل رگرسیونی چندمتغیره
۵۸	۶.۵ کشف واریانس ناهمسانی
۵۹	۷.۵ آزمون Breusch-Pagan در نرم افزار Eviews
۶۰	۸.۵ Glesjer LM Test
۶۱	۹.۵ آزمون گلچسر در نرم افزار Eviews
۶۱	۱۰.۵ آزمون Harvey-Godfrey-LM Test
۶۲	۱۱.۵ آزمون Harvey-Godfrey در Eviews
۶۳	۱۲.۵ آزمون پارک
۶۴	۱۳.۵ آزمون پارک در نرم افزار Eviews
۶۴	۱۴.۵ آزمون Goldfeld-Quandt
۶۵	۱۵.۵ آزمون Goldfeld-Quant در نرم افزار Eviews
۶۶	۱۶.۵ آزمون White
۶۷	۱۷.۵ آزمون وایت در نرم افزار Eviews
۶۷	۱۸.۵ آزمون Engle's ARCH
۶۸	۱۹.۵ آزمون ARCH در نرم افزارهای Eviews و Microfit
۶۹	۲۰.۵ حل مشکل واریانس ناهمسانی

فصل ششم

۷۰	۱.۶ ریشه واحد چیست؟
۷۲	۲.۶ آزمون ریشه واحد
۷۲	۳.۶ آزمون دیکی-فولر
۷۴	۴.۶ آزمون فیلیپس - برون
۷۴	۵.۶ آزمون ریشه واحد در نرم افزار Eviews

فصل هفتم

۷۶	۱.۷ هم انباشتگی و مدل های تصحیح خطا
۷۶	۲.۷ هم انباشتگی و مدل تصحیح خطا
۷۹	۳.۷ آزمون هم انباشتگی با روش انگل گرنجر
۸۱	۴.۷ روش EG در Eviews

۵.۷	روش آزمون یوهانسون (Johanson)	۸۱
۶.۷	بررسی روش یوهانسون در نرم افزار Eviews	۸۴

فصل هشتم

۱.۸	مدل خودرگرسیون برداری (VAR^1)	۸۶
۲.۸	مدل VAR	۸۶
۳.۸	آزمون علیت	۹۰
۴.۸	تخمین مدل VAR در نرم افزار آویوز	۹۰
۵.۸	آزمون علیت گرنجری	۹۳

فصل نهم

۱.۹	معرفی معادلات همزمان	۹۶
۲.۹	بررسی امکان شناسایی مدل‌ها	۹۷
۳.۹	تخمین معادلات همزمان در نرم افزار Eviews	۹۷
۴.۹	یک مثال موردی	۹۸

فصل دهم

۱.۱۰	استفاده از متغیرهای دامی	۱۰۰
۲.۱۰	بررسی تاثیر چند متغیر دامی	۱۰۱

فصل یازدهم

۱.۱۱	روش گشتاورهای تعمیم یافته (GMM^2)	۱۰۴
۲.۱۱	استفاده از روش GMM در نرم افزار Eviews	۱۰۶

فصل دوازدهم

۱.۱۲	ارائه چند برنامه در نرم افزار متلب	۱۰۸
۲.۱۲	برای بررسی خود همبستگی	۱۰۸
۳.۱۲	راه حل دوم برای بررسی خود همبستگی	۱۰۹

¹ Vector Autoregressive

² Generalized Method of Moments

- ۴.۱۲ بررسی وجود اثرات ARCH ۱۱۰
- ۵.۱۲ انجام آزمون نرمالیتی در متلب ۱۱۰
- ۶.۱۲ نحوه به دست آوردن درجه صحیح P و q در مدل $ARMA(P,q)$ ۱۲۵

فصل سیزدهم

- ۱.۱۳ معرفی مدل پنل ۱۱۳
- ۲.۱۳ مروری بر آزمون هاسمن ۱۱۵
- ۳.۱۳ تخمین مدل پنل در نرم افزار ایویوز ۱۱۶
- ۴.۱۳ آزمون ریشه واحد در پنل ۱۱۷
- ۵.۱۳ آزمون ریشه واحد پنل در نرم افزار ایویوز ۱۱۸
- ۶.۱۳ بررسی هم انباشتگی در مدل پنل ۱۱۹
- ۷.۱۳ آزمون هم انباشتگی در مدل های پنل در نرم افزار ایویوز ۱۲۰

فصل چهاردهم

- ۱.۱۴ اقتصاد سنجی فضایی ۱۲۲
- ۲.۱۴ مدل توبیت ۱۲۳
- ۳.۱۴ معرفی تابع واکنش آنی ۱۲۴
- ۴.۱۴ استخراج تابع واکنش آنی در نرم افزار ایویوز ۱۲۵

فصل پانزدهم

- ۱.۱۵ معرفی نوعی از شبکه عصبی موسوم به GMDH ۱۲۷
- ۲.۱۵ معرفی سامانه خبره قاعده گرا ۱۲۳
- ۳.۱۵ مزایای سامانه خبره قاعده گرا ۱۳۴
- ۴.۱۵ معایب سامانه خبره قاعده گرا ۱۳۵

منابع و مآخذ

استفاده از نرم افزارهای کاربردی یکی از ابزار لازم برای انجام تمامی مطالعات اقتصادی است. در این کتاب مولف باتوجه به تجربه تدریس این نرم افزارها به دانشجویان مختلف، به دنبال معرفی ساده نحوه کاربرد نرم افزارهای کاربردی اقتصاد می باشد. لذا تلاش گردیده بعد از بیان مهمترین مدل‌های کاربردی در اقتصادسنجی و مدلسازی، نحوه دقیق تخمین این مدل‌ها در نرم‌افزارهای ایویوز، در برخی موارد مایکروفت و نرم افزار متلب (به صورت مجزا) به ساده ترین زبان ممکن بیان گردد.

در فصل اول این کتاب نکات کلیدی در نرم افزار ایویوز بیان گردیده است. در فصل‌های بعد به ترتیب مدل‌های ARMA، مدل‌های گروه ARCH-GARCH، مشکل خودهمبستگی و راه‌های رفع و کشف آن، مشکل واریانس ناهمسانی و راه‌های رفع و کشف آن، آزمون‌های ریشه واحد، هم‌انباشتگی و مدل تصحیح خطا، مدل VAR، معادلات همزمان، متغیرهای دامی، مدل GMM، ارائه چند برنامه کاربردی در نرم افزار متلب، مدل پنل، مدل‌های جدید مثل اقتصادسنجی فضایی، مدل توبیت، تابع واکنش آنی و در انتها نیز شبکه عصبی GMDH و سامانه خبره قاعده گرا معرفی شده اند. در تمام کتاب مولف تلاش کرده است با زبانی بسیار ساده و کاربردی به بیان مطالب مذکور بپردازد. لذا علاوه بر بیان مطالب نظری به صورت دقیق مطالب مربوط به نحوه اجرای فرامین در نرم افزارهای ایویوز، متلب و مایکروفت ذکر گردیده است.