

به نام خداوند بخشنده مهربان

راهنمای مسائل اقتصاد سنجی

دامودار گجراتی

ترجمه و تدوین:

صالح طاهری

حسن حیدریان

رضا جمشیدی



مشهد ۱۳۸۵

گجراتی، دامودار-

راهنمای مسائل اقتصاد سنجی / مؤلف: دامودار گجراتی، ترجمه: صالح طاهری، حسن
حیدریان، رضا جمشیدی - مشهد: سخن گستر، ۱۳۸۵.
۳۱۲ + ۸ ص: جدول، نمودار.

ISBN: 964 - 964 - 477-239 - 3

فهرست نویسی بر اساس اطلاعات فیبا.

۱- اقتصاد سنجی، ۲- تئوری اقتصاد، ۳- نظریه اقتصادی، الف- گجراتی، دامودار.

ب. مترجمین: ج. عنوان.

۵۴۱ / ۸۹۳

PT ۹۳۷ / ت ۳۶ د ۸

۸۵-۳۱۴۶

کتابخانه ملی ایران



انتشارات سخن گستر

مشهد - بین ابن سینای ۱۶ و پاستور - شماره ۱۷۴

تلفن: ۸۴۳۹۹۵۵

نام کتاب: راهنمای مسائل اقتصاد سنجی

مؤلف: دامودار گجراتی

ترجمه و تدوین: صالح طاهری - حسن حیدریان - رضا جمشیدی

شمارگان: ۱۰۰۰ جلد

نوبت چاپ: اول - پاییز / ۱۳۸۵

چاپ: چاپخانه سروش

قیمت: ۲۵۰۰ تومان

شابک: ۹۶۴-۳۳۹-۲۳۹-۳

امروزه اقتصاد سنجی یکی از متداولترین ابزار جهت اثبات فرضیه ها و تئوری های اقتصادی بالاخص تئوریهای اقتصاد کلان می باشد. این که آیا اقتصاد سنجی شایستگی این توجه را دارد موضوعی مهم است اما مهمتر آن است که این ابزار به درستی و با تسلط کافی مورد استفاده قرار گیرد. متأسفانه در برخورد با این روش دو دیدگاه قابل انتقاد در کشور وجود دارد:

اول اینکه محقق تنها به سراغ اطلاعاتی چون R^2 ، دوربین واتسون و آماره F رفته و تمام تلاش خود را در جهت نمایش بهتری از این اطلاعات بکار گیرد.

دوم اینکه از ابتدا با توجه نقص این ابزار، اقتصاد سنجی مورد نکوهش قرار گیرد. درخصوص دیدگاه اول باید گفت که روی آوردن به اطلاعات مذکور تنها بخش ناچیزی از قسمت آماری اقتصاد سنجی است، حال آنکه در اقتصاد سنجی تصریح صحیح مدل آن هم با اتکا به تئوری های اقتصادی و استفاده از آزمونهای مختلف جهت رفع مشکلات آماری و تصریح گام به گام مدل از ارزش بالایی برخوردار است.

درخصوص دیدگاه دوم که البته گاهی با نقلی از برخی نظریه پردازهای غربی همراه می گردد، باید گفت این سخنان در حالی از سوی آنها ارائه می شود که این گروه اولاً تسلط کافی بر اقتصاد سنجی دارند و ثانیاً به همان نسبت بر سایر ابزار و روشها نیز اشراف دارند.

لذا در تلاش برای اصلاح هر دو دیدگاه موجود انتشار و ترجمه منابع معتبر کارگشا خواهد بود و به نظر رسید ترجمه و تدوین راهنمای مبانی اقتصاد سنجی گجراتی مفید واقع شود چرا که با مطالعه کتاب اصلی و درک صحیح مطالب و تمرینهای آن، روش گام به گام برای تسلط بر اقتصاد سنجی و اثبات فرضیه های مورد نظر محقق، بویژه از نوع اقتصادی آن، فراوری خواننده قرار خواهد گرفت.

کتاب حاضر در واقع برگرفته از ویرایش چهارم سال ۲۰۰۳ کتاب مبانی اقتصاد سنجی گجراتی است. البته از آنجایی که متن فارسی کتاب مذکور با ویرایش چهارم در اختیار علاقمندان در کشور نمی باشد سعی شد تا حد امکان کتابی مستقل ارائه شود بطوریکه با نگاهی به آخرین ویرایش ارائه شده موجود در بازار بصورت فارسی که از سوی جناب آقای دکتر ابریشمی ارائه شده برای تمرینهای جدید پاورقی مناسب در تشریح بیشتر مسائل جدید ارائه شود تا خواننده مشکلی در این خصوص نداشته باشد.

مطمئناً نتیجه این کار خالی از ایراد نخواهد بود با توجه به اینکه کمبود منابع نه تنها در اقتصاد سنجی بلکه در کلیه گرایشهای اقتصادی قابل احساس است هر کوششی از نوع اولیه آن حتماً حاوی ایراداتی

است و این کتاب مستثنا نخواهد بود. لذا مترجمین دست تمام کسانی که با انتقادهای سازنده خود در راستای بهبود این کتاب گام بر می دارند را به گرمی می فشارند.

در پایان از کمکها و تلاش تمام عزیزان که به هر طریق ما را در تهیه این کتاب ما را یاری نموده اند، بویژه سرکار خانم نرگس حسن زاده، سرکار خانم مکرم، جناب آقای حسن پرورنده فریمانی و جناب آقای ایمانی مسئول محترم انتشارات سخن گستر کمال تشکر را داریم و توفیق روزافزون همگی را از درگاه ایزد متان خواهیم خواست.

فهرست مطالب

عنوان فصل شماره صفحه

فصل اول: ماهیت تحلیل رگرسیون ۱

فصل دوم: تحلیل رگرسیون دو متغیره؛ برخی مفاهیم اساسی ۱۳

فصل سوم: مدل رگرسیون دو متغیره؛ مسئله تخمین ۲۹

فصل چهارم: فرض نرمال؛ مدل رگرسیون خطی نرمال کلاسیک (CNLRM) ۵۳

فصل پنجم: رگرسیون دو متغیره؛ تخمین فاصله ای و آزمون فرضیه ۵۷

فصل ششم: گسترش مدل رگرسیون خطی دو متغیره ۸۵

فصل هفتم: تحلیل رگرسیون چند متغیره (مرکب)؛ مسئله تخمین ۱۰۳

فصل هشتم: تحلیل رگرسیون چند متغیره (مرکب)؛ مسئله استنتاج آماری ۱۳۲

فصل نهم: رگرسیون با متغیرهای مجازی ۱۷۳

فصل دهم: همخطی ۲۱۱

فصل یازدهم: ناهمسانی واریانس ۲۴۳

فصل دوازدهم: خودهمبستگی ۲۷۳