

سانی اقتصادسنجی

همراه با ایویوز و استاتا

تالیف:

دکتر محمد رضا منجذب

(دانشیار دانشکده اقتصاد دانشگاه خوارزمی تهران)

رضا نصرتی

(کارشناس سازمان مدیریت و برنامه‌ریزی استان آذربایجان شرقی)



کتاب‌مهربان

Mehraban Book

سمت‌شناسه	متن‌بذ، محمدرضا، ۱۳۴۰ -
عنوان و نام پدیدآور	مبانی اقتصادسنجی: همراه با ایویوز و استاتاستیک/ تألیف محمدرضا متن‌بذ، رضا نصرتی.
مشخصات نشر	تهران: موسسه کتاب‌مهربان نشر، ۱۳۹۶.
مشخصات ظاهری	ج ۲.
شابک	۹۷۸-۶۰۰-۴۰۷-۱۶۰-۴
وضعیت فهرست‌نویسی	فیب
یادداشت	کتابنامه
موضوع	نرم‌افزار استاتاستیک
موضوع	ای ویوز (قابل کامپیوتر)
موضوع	اقتصادسنجی
موضوع	اقتصادسنجی - برنامه‌های کامپیوتری
شناسه نزوده	نصرتی، رضا، ۱۳۵۱ -
رده‌بندی کنگره	HB ۱۳۹۶.۰۲۳۹۶
رده‌بندی دیویی	۳۱۰-۱۹۵
شماره کتابشناسی ملی	۴۹۳۲۶

عنوان	مبانی اقتصادسنجی: همراه با ایویوز و استاتاستیک
مؤلفان	دکتر محمدرضا متن‌بذ، رضا نصرتی
ناشر	مؤسسه کتاب‌مهربان نشر
صفحه‌آرا	مسین امدی
ویراستار علمی	دکتر میثم رافعی
طراح جلد	امیتیس ضیایی مهر
شابک	۹۷۸-۶۰۰-۴۰۷-۱۶۰-۴
نوبت چاپ	اول پاییز ۱۳۹۶
تیراژ	۱۰۰۰ نسخه

دفتر انتشارات: تهران، خیابان انقلاب، خیابان ۱۴ فروردین، خیابان لبافی‌نژاد، پلاک ۶۶۹۷۳۱۷۵-۶
کدپستی: ۱۳۱۴۹۶۵۳۵۱

ایمیل و وب سایت: Info@mehrabanshop.com : MehrabanPub.com
فروشگاه اینترنتی: Ketabemehraban.com
فروشگاه نشر بازرگانی: تلفن: ۶۶۴۶۳۱۰۲

کلیه حقوق و حق چاپ متن و عنوان کتاب که به ثبت رسیده است، مطابق با قانون حقوق مؤلفان و مصنفان مصوب ۱۳۴۸ محفوظ و متعلق به مترجم می‌باشد. هر گونه برداشت، تکثیر، کی‌برداری به هر شکل (چاپ، فتوکپی، انتشار الکترونیکی) بدون اجازه‌ی کتبی از مترجم نشر ممنوع بوده و متخلفین تحت پیگرد قانونی قرار خواهند گرفت.

کتاب‌مهربان

فهرست مطالب

۹	 مقدمه
۱۳	 فصل اول؛ مقدمات اقتصادسنجی
۱۳	 اقتصادسنجی
۱۴	 احتمال در اقتصادسنجی
۱۵	 مدل سازی بر اقتصادسنجی
۱۷	 داده و منابع اطلاعات آماری
۲۰	 آمار در اقتصادسنجی
۲۵	 نرم افزارهای اقتصادسنجی
۲۵	 کاربرد نرم افزار ایویوز (فصل ۱)
۳۱	 کاربرد نرم افزار استاتا (فصل ۱)
۳۷	 فصل دوم؛ معادله رگرسیون
۳۷	 مقدمه
۴۲	 روش حداقل مربعات معمولی
۴۲	 محاسبه پارامترهای نمونه در رگرسیون
۴۸	 معرفی اجمالی فروض کلاسیک
۵۱	 خواص تخمین زننده های روش حداقل مربعات معمولی
۵۸	 ضریب تعیین

۶۱	آزمون معناداری ضرایب رگرسیون
۶۳	آزمون معناداری کل رگرسیون:
۶۴	کاربرد نرم افزار ایویوز (فصل ۲)
۷۴	کاربرد نرم افزار استاتا (فصل ۲)
۸۳	مسائل فصل دوم
۸۵	فصل سوم؛ رگرسیون های چند متغیره
۸۵	مقاله
۸۶	تعیین ضرایب α و β در رگرسیون دو متغیره
۸۸	ضریب تعیین: تعریف و تفسیر
۹۰	آزمون معنی دار بودن ضرایب رگرسیون
۹۱	آزمون معناداری کل رگرسیون
۹۱	آزمون محدودیت ضرایب
۹۲	رگرسیون های k متغیره
۹۹	کاربرد نرم افزار ایویوز (فصل ۳)
۱۰۴	کاربرد نرم افزار استاتا (فصل ۳)
۱۰۶	مسائل فصل سوم
۱۰۷	فصل چهارم؛ نقض فروض کلاسیک
۱۰۷	مقدمه

۱۰۷.....	فرض میانگین صفر اجزای اخلاص
۱۰۹.....	فرض همسانی واریانس
۱۱۱.....	روش های تشخیص واریانس ناهمسانی
۱۱۹.....	فرض عدم وجود خود همبستگی
۱۲۲.....	روش های تشخیص خود همبستگی
۱۲۹.....	روش های رفع خود همبستگی در جملات اخلاص
۱۳۳.....	فرض نرمال بودن توزیع اجزای اخلاص
۱۳۴.....	آزمون های نرمال بودن توزیع اجزای اخلاص
۱۳۶.....	روش نرمال نمودن توزیع ای دار چولگی
۱۳۷.....	کاربرد نرم افزار ایوبوز (فصل ۱)
۱۵۷.....	کاربرد نرم افزار استاتا (فصل ۴)
۱۶۴.....	مسائل مربوط به فصل چهارم
۱۶۷.....	فصل پنجم؛ آزمون های تصریح مدل
۱۶۷.....	هم خطی
۱۷۲.....	متغیرهای مجازی
۱۷۶.....	آزمون های ثبات ضرایب
۱۸۳.....	آزمون فرم تابعی غلط (ریست رمزی)
۱۸۶.....	آزمون حذف متغیر توضیحی
۱۸۷.....	آزمون اضافه نمودن متغیرهای غیر مرتبط

۱۸۸	پیش‌بینی
۱۹۰	آزمون علیت
۱۹۲	کاربرد نرم افزار ایویوز (فصل ۵)
۲۱۳	کاربرد نرم افزار استاتا (فصل ۵)
۲۱۸	مسائل مربوط به فصل پنجم
۲۲۱	فصل ششم؛ ریشه واحد و هم‌انباشتگی
۲۲۱	ریشه واحد
۲۲۳	رابطه‌ی قطعی تصادفی
۲۲۶	آزمون‌های ریشه واحد
۲۳۶	هم‌انباشتگی
۲۳۸	ارتباط مدل‌های آماری و رگرسیون مانا
۲۳۹	کاربرد نرم افزار ایویوز (فصل ۶)
۲۵۵	کاربرد نرم افزار استاتا (فصل ۶)
۲۶۰	مسائل مربوط به فصل ششم
۲۶۱	منابع و مآخذ
۲۶۵	ضمائم

● مقدمه

کتاب پیش‌رو حاصل بررسی و مطالعه‌هایی است که در خصوص نیاز واقعی دانشجویان و محققان به مباحث اقتصادسنجی تهیه شده است. این کتاب با نام مدل‌های اقتصادسنجی در دو مجلد تدوین می‌شود که در جلد اول به مقدمات اقتصادسنجی و در جلد دوم به مدل‌های اقتصادسنجی پرداخته شده است. همچنین در آخر هر فصل از کتاب نحوه کاربرد نرم افزارهای ایویوز (نسخه ۱۰) و آتانا (نسخه ۱۲) مربوط به همان فصل یا توضیحات مفصل و گام به گام ارائه شده است. سعی چرین سال تدریس، مشاوره و راهنمایی دانشجویان در مقاطع کارشناسی ارشد و دکتری، متوجه ضعف در تحلیل کمی و تشخیص نوع مدل اقتصادسنجی برای تعیین ماه و بر اساس این تجربه گرانبها سعی گردید مجموعه‌ای از مباحث اقتصادسنجی - که این شود تا دانشجویان و محققان عزیز به راحتی بتوانند با این مباحث ارتباط برقرار کنند و درک راحت‌تر و کاربردی‌تری از آن داشته باشند. لذا این کتاب نسبت به سایر کتاب‌های اقتصادسنجی دارای مزیت‌هایی است که به مواردی از آنها اشاره می‌شود:

❑ دوری از بکارگیری معادلات و فرمول‌های پیچیده ریاضی و آمار و سعی در ارائه این مباحث در سطح دانش عمومی دانشجویان و محققان.

❑ ارائه مباحث مربوط به نحوه بکارگیری نرم افزارهای ایویوز و استاتا به صورت تفصیلی و گام به گام.

❑ بیان توضیحات کامل در خصوص نحوه تشخیص نوع مدل مورد نیاز

دانشجویان و محققان با توجه به اطلاعات در دسترس.

□ بیان نقطه شروع و پایان تجزیه و تحلیل اقتصادسنجی یک کار تحقیقی با توجه به مدل منتخب.

□ معرفی مدل‌هایی که به صورت عموم و فراگیر در دانشگاه‌ها و مراکز علمی و تحقیقی در زمینه‌های علوم اقتصادی و علوم اجتماعی کاربرد دارند.

□ ارائه اطلاعات و داده‌ها برای هر یک از مدل‌ها و بیان تخمین آن مدل به صورت عملی در سایت www.eghtesad.info و www.dmonjazeib.com موجود است.

□ حجم و ارزان بودن کتاب بدلیل رعایت حال مصرف‌کننده.

این کتاب شامل فصل اول است. فصل اول با عنوان مقدمات اقتصادسنجی به بیان مباحثی از تعریف اقتصادسنجی، احتمال در اقتصادسنجی، مدل‌سازی، داده و منابع اطلاعاتی، آمار اقتصادسنجی و مقدمات استفاده از نرم‌افزارها پرداخته است. فصل دوم با عنوان معادله رگرسیون به بیان مباحثی از قبیل مدل رگرسیون خطی، روش حداقل مربعات معمولی، پارامترهای نمونه در رگرسیون، معرفی اجمالی فروض کلاسیک، خواص تخمین روش حداقل مربعات معمولی، ضریب تعیین، آزمون‌های معناداری و کاربرد نرم‌افزارها مربوط به مطالب این فصل پرداخته است. فصل سوم با عنوان رگرسیون‌های چندمتغیره به بیان مباحثی از قبیل تخمین ضرایب در رگرسیون دو متغیره، ضریب تعیین تعدیل شده، آزمون محدودیت، رگرسیون‌های k متغیره و کاربرد نرم‌افزارها مربوط به مطالب این فصل پرداخته است. فصل چهارم با عنوان نقض فروض کلاسیک به مباحث آزمون‌های مربوط به فروض کلاسیک و راهکارهای رفع نقض آنها

به همراه کاربرد نرم افزارها مربوط به مطالب این فصل پرداخته است. در فصل پنجم با عنوان آزمون های تصریح مدل به مباحث هم خطی، راه های کاهش هم خطی، متغیرهای مجازی، آزمون ثبات ضرایب، آزمون فرم تابعی غلط، آزمون حذف متغیرهای مهم، آزمون اضافه کردن متغیرهای نامربوط، آزمون علیت و کاربرد نرم افزارها مربوط به مطالب این فصل پرداخته است. در نهایت در فصل ششم نیز با عنوان هم انباشتگی و ریشه واحد به مباحث مانایی، هم انباشتگی، شکست ساختاری، کاربرد نرم افزارها مربوط به مطالب این فصل پرداخته است. تنوع و گستردگی مباحث اقتصادسنجی و پیشرفت روز به روز این علم و تکامل سریع آن با گسترش راه های افزودن تئوری ها و نظریات امکان ارائه جامع و کامل مطالب را میسر نمی سازد. این کتاب تلاش می برای ارتباط بیش از پیش دانشجویان و محققان با علم اقتصادسنجی و گسترش کاربرد این علم در بین تصمیم گیران و محققان است. یقیناً در نگارش و ارائه مطالب، کاستی ها و نقایصی وجود دارد که ارائه نظرات اصلاحی خوانندگان می تواند در رفع کاستی ها مؤثر باشد. منتظر دریافت دیدگاه ها، انتقادات و پیشنهادهای ارزشمند همکاران، دانشجویان، محققان و خوانندگان کتاب هستیم. لطفاً نظرات خود را به آدرس rezanosrati13@gmail.com ارسال فرمایید. در پایان لازم است از تمامی عزیزانی که با راهنمایی و ارائه راهکار ما را در نوشتن کتاب یاری نمودند به ویژه جناب آقای دکتر رافعی ویراستار علمی کتاب تشکر و قدردانی نماییم. همچنین از صبر، حوصله و تحمل همسرانمان که با تقبل مسئولیت ها در زمانی که به نوشتن کتاب مشغول بودیم سپاسگزاری نموده و این اثر را به آنها تقدیم می نماییم.