

بدی بالتاجی

اقتصاد سنجی

مترجمان: رضا طالبلو / شعله باقری پرمهر



نشرنی

سرشناسه: بالتاجی، بذیع هانی (Badi Hani, Badi H. Baltagi)
 عنوان و نام پدیدآور: اقتصادسنجی/ بدی ایچ. بالتاجی؛ مترجمان رضا طالبلو، شعله باقری پرمهر.
 مشخصات نشر: تهران، نشر نی، ۱۳۹۱.
 مشخصات ظاهری: ۶۲۵ ص.
 شابک: 978-964-185-280-3
 وضعیت فهرست‌نویسی: فیبا
 یادداشت: عنوان اصلی: **Econometrics, the 4 ed.**
 یادداشت: واژه‌نامه.
 موضوع: اقتصادسنجی.
 شناسه افزوده: طالبلو، رضا، ۱۳۶۱ - ، مترجم؛ باقری پرمهر، شعله، ۱۳۶۳ - ، مترجم.
 رده‌بندی کنگره: ۱۳۹۱ ۷ الف ب/ب HB۱۳۹
 رده‌بندی دیویی: ۳۳۰/۰۱۵۱۹۵
 شماره کتابشناسی ملی: ۲۸۵۵۷۲۴



نشرنی

اقتصادسنجی

بدی ایچ. بالتاجی

مترجمان دکتر رضا طالبلو (عضو هیئت علمی دانشگاه

علامه طباطبائی) / دکتر شعله باقری پرمهر

چاپ اول بهران، ۱۳۹۱

تعداد ۱۰۰۰ نسخه

لیتوگرافی غزال

چاپ و صحافی سپیدار

ناظر چاپ بهمن سراج

تمامی حقوق این اثر محفوظ است. تکثیر یا تولید مجدد آن کلاً و جزاً،

به هر صورت (چاپ، فتوکپی، صوت، تصویر و انتشار الکترونیکی)

بدون اجازه مکتوب ناشر ممنوع است.

شابک ۹۷۸ ۹۶۴ ۱۸۵ ۲۸۰ ۳

www.nashreny.com

قیمت: ۱۶۰۰۰ تومان

فهرست مطالب

مقدمه	۱۲
-------	----

بخش اول ۱۵

فصل اول: اقتصادسنجی چیست؟	۱۷
---------------------------	----

۱-۱. مقدمه	۱۷
------------	----

۲-۱. تاریخچه مختصر اقتصادسنجی	۲۱
-------------------------------	----

۳-۱. نقدهایی بر اقتصادسنجی	۲۵
----------------------------	----

۴-۱. نگاهی به آینده اقتصادسنجی	۲۶
--------------------------------	----

منابع	۲۹
-------	----

فصل دوم: مفاهیم پایه‌ای آمار	۳۲
------------------------------	----

۱-۲. مقدمه	۳۲
------------	----

۲-۲. روش‌های تخمین	۳۲
--------------------	----

۳-۲. ویژگی‌های تخمین‌زن‌ها	۳۸
----------------------------	----

۴-۲. آزمون فرضیه‌ها	۴۶
---------------------	----

۵-۲. فاصله اطمینان	۶۰
--------------------	----

۶۲	۶-۲. آماره توصیفی
۶۸	مسائل
۷۸	منابع

۸۹	فصل سوم: رگرسیون ساده خطی
۸۹	۱-۳. مقدمه
۹۲	۲-۳. روش تخمین حداقل مربعات و فروض کلاسیک
۹۸	۳-۳. خواص آماری حداقل مربعات معمولی
۱۰۱	۴-۳. تخمین σ^2
۱۰۲	۵-۳. روش تخمین حداکثر درست‌نمایی
۱۰۵	۶-۳. یک معیار برازش
۱۰۸	۷-۳. پیش‌بینی
۱۱۰	۸-۳. تحلیل باقیمانده
۱۱۲	۹-۳. مثال عددی
۱۱۷	۱۰-۳. مثال تجربی
۱۱۸	مسائل
۱۲۶	منابع

۱۲۹	فصل چهارم: تحلیل رگرسیون مرکب
۱۲۹	۱-۴. مقدمه
۱۳۰	۲-۴. تخمین از روش حداقل مربعات
۱۳۲	۳-۴. تفسیر باقیمانده‌ها در تخمین رگرسیون (چندگانه) مرکب
۱۳۴	۴-۴. تصریح الگوی معادله رگرسیونی با متغیرهای بیش‌تر و یا متغیرهای کم‌تر
۱۳۷	۵-۴. مقایسه R^2 و R^2 تعدیل‌شده
۱۳۸	۶-۴. آزمون قیود خطی
۱۴۲	۷-۴. متغیرهای مجازی
۱۵۰	نکته
۱۵۰	مسائل
۱۵۹	منابع

فصل پنجم: نقض فروض کلاسیک.....	۱۶۵
۱-۵. مقدمه.....	۱۶۵
۲-۵. فرض میانگین صفر.....	۱۶۵
۳-۵. متغیرهای توضیحی تصادفی.....	۱۶۶
۴-۵. نرمال بودن اجزای اخلاص.....	۱۷۰
۵-۵. واریانس ناهمسانی.....	۱۷۲
۶-۵. خودهمبستگی.....	۱۹۱
مسائل.....	۲۰۶
منابع.....	۲۱۶
فصل ششم: الگوهای پویا و وقفه‌های توزیع شده.....	۲۲۱
۱-۶. مقدمه.....	۲۲۱
۲-۶. وقفه توزیعی نامحدود.....	۲۳۱
۱-۲-۶. مدل انتظارات تطبیقی (AEM).....	۲۳۲
۲-۲-۶. مدل تطبیقی جزئی (PAM).....	۲۳۳
۳-۶. برآورد و آزمون مدل‌های پویای دارای همبستگی سریالی.....	۲۳۴
۱-۳-۶. مدل متغیر وابسته وقفه‌دار با توزیع $AR(1)$	۲۳۶
۲-۳-۶. یک مدل متغیر وابسته با وقفه با توزیع $MA(1)$	۲۳۹
۴-۶. وقفه توزیعی خودرگرسیون.....	۲۴۱
مسائل.....	۲۴۲
منابع.....	۲۴۶

بخش دوم ۲۴۹

فصل هفتم: الگوی خطی عمومی: اصول.....	۲۵۱
۱-۷. مقدمه.....	۲۵۱
۲-۷. تخمین حداقل مربعات.....	۲۵۲
۳-۷. رگرسیون افراز شده و قضیه فریش-واک-لاول.....	۲۵۸
۴-۷. تخمین حداکثر درست‌نمایی.....	۲۶۱

۲۶۵.....	۵-۷. پیش‌بینی.....
۲۶۷.....	۶-۷. فاصله‌های اطمینان و آزمون فرضیه‌ها.....
۲۶۸.....	۷-۷. فواصل اطمینان مشترک و آزمون فرضیه‌ها.....
۲۷۰.....	۸-۷. تخمین‌زن MLE مقید و حداقل مربعات مقید.....
۲۷۱.....	۹-۷. آزمون‌های نسبت درست‌نمایی، والد و ضریب لاگرانژ.....
۲۸۰.....	نکات.....
۲۸۱.....	مسائل.....
۲۹۰.....	منابع.....
۳۰۱.....	فصل هشتم: آزمون‌های تصریح و عیب‌یابی رگرسیون.....
۳۰۱.....	۱-۸. مشاهدات مؤثر.....
۳۱۶.....	۲-۸. باقیمانده‌های بازگشتی.....
۳۲۵.....	۳-۸. آزمون‌های تصریح.....
۳۴۲.....	۴-۸. رگرسیون گوس-نیوتن و حداقل مربعات غیرخطی.....
۳۵۳.....	۵-۸. آزمون فرم تبعی خطی در مقابل لگاریتم خطی.....
۳۵۶.....	نکات.....
۳۵۶.....	مسائل.....
۳۶۴.....	منابع.....
۳۶۷.....	فصل نهم: حداقل مربعات تعمیم‌یافته.....
۳۶۷.....	۱-۹. مقدمه.....
۳۶۸.....	۲-۹. حداقل مربعات تعمیم‌یافته.....
۳۷۱.....	۳-۹. فرم‌های خاص Ω
۳۷۳.....	۴-۹. برآورد حداکثر درست‌نمایی.....
۳۷۴.....	۵-۹. آزمون فرضیه‌ها.....
۳۷۵.....	۶-۹. پیش‌بینی.....
۳۷۶.....	۷-۹. Ω مجهول.....
۳۷۷.....	۸-۹. نگاهی دوباره به آماره‌های W ، LR و LM

۳۸۰	۹-۹. همبستگی فضایی جملات اخلاص
۳۸۳	مسائل
۳۹۱	منابع

۳۹۵	فصل دهم: رگرسیون‌های به ظاهر نامرتبط
۳۹۵	۱-۱۰. مقدمه
۳۹۹	۲-۱۰. برآورد GLS امکان‌پذیر
۴۰۳	۳-۱۰. آزمون نظری بودن ماتریس واریانس-کوواریانس
۴۰۴	۴-۱۰. رگرسیون‌های به ظاهر نامرتبط با مشاهدات نابرابر
۴۰۷	۵-۱۰. مثال تجربی
۴۱۰	مسائل
۴۱۶	منابع

۴۱۹	فصل یازدهم: الگوی معادلات هم‌زمان
۴۱۹	۱-۱۱. مقدمه
۴۲۰	۱-۱-۱۱. ارب هم‌زمانی
۴۲۵	۲-۱-۱۱. مشکل شناسایی
۴۳۰	۲-۱۱. روش‌های برآورد تک‌معادله‌ای: حداقل مربعات دو مرحله‌ای
۴۴۳	۱-۲-۱۱. وابستگی وقفه‌ای فضایی
۴۴۵	۳-۱۱. برآورد سیستم: حداقل مربعات سه مرحله‌ای
۴۴۷	۴-۱۱. آزمون محدودیت‌های بیش از حد شناسایی شده
۴۵۰	۵-۱۱. آزمون تصریح هاسمن
۴۵۴	۶-۱۱. مثال تجربی: جنایت در کارولینای شمالی
۴۶۰	مسائل
۴۷۷	منابع

۴۸۷	فصل دوازدهم: مدل تلفیقی داده‌های سری‌زمانی و مقطع‌زمانی
۴۸۷	۱-۱۲. مقدمه
۴۸۸	۲-۱۲. مدل با اجزای خطا

۴۹۰	۱۲-۱۵. مدل با اثرات ثابت
۴۹۴	۱۲-۲. الگوی اثرات تصادفی
۵۰۱	۱۲-۳. تخمین حداکثر درست‌نمایی
۵۰۲	۱۲-۳. پیش‌بینی
۵۰۳	۱۲-۴. مثال تجربی
۵۰۷	۱۲-۵. آزمون در مورد یک الگوی تلفیق‌شده
۵۱۵	۱۲-۶. الگوی پانل پویا
۵۲۰	۱۲-۶-۱. مثال تجربی
۵۲۲	۱۲-۷. ارزیابی برنامه و تخمین‌زن تفاوت در تفاضل‌ها
۵۲۴	۱۲-۷-۱. تخمین‌زن تفاوت در تفاضل‌ها
۵۲۵	مسائل
۵۳۰	منابع
۵۳۳	فصل سیزدهم: متغیرهای وابسته محدودشده
۵۳۳	۱۳-۱. مقدمه
۵۳۳	۱۳-۲. الگوی احتمال خطی
۵۳۶	۱۳-۳. فرم تبعی: لوجیت و پروبیت
۵۳۸	۱۳-۴. داده‌های گروه‌بندی‌شده
۵۴۶	۱۳-۵. داده‌های انفرادی: پروبیت و لوجیت
۵۴۹	۱۳-۶. رگرسیون الگوی پاسخ به صورت دودویی
۵۵۱	۱۳-۷. واریانس‌های مجانبی پیش‌بینی‌ها و اثرات نهایی
۵۵۲	۱۳-۸. معیارهای خوبی برازش
۵۵۴	۱۳-۹. مثال‌های تجربی
۵۵۹	۱۳-۱۰. الگوی انتخاب چندجمله‌ای
۵۵۹	۱۳-۱۰-۱. الگوهای پاسخ ترتیبی
۵۶۱	۱۳-۱۰-۲. الگوهای پاسخ بدون ترتیب
۵۶۴	۱۳-۱۱. الگوی رگرسیون سانسورشده
۵۶۸	۱۳-۱۲. الگوی رگرسیون بریده‌شده
۵۷۰	۱۳-۱۳. انتخابی بودن نمونه

نکات.....	۵۷۳
مسائل.....	۵۷۴
منابع.....	۵۸۱

فصل چهاردهم تحلیل سری‌های زمانی..... ۵۸۷

۱-۱۴. مقدمه.....	۵۸۷
۲-۱۴. مانایی.....	۵۸۸
۳-۱۴. روش باکس-جنگنز.....	۵۹۰
۴-۱۴. خودرگرسیون برداری.....	۵۹۵
۵-۱۴. ریشه‌های واحد.....	۵۹۶
۶-۱۴. مانایی در روند در مقابل مانایی در تفاضل (روند مانا در مقابل تفاضل مانا).....	۶۰۲
۷-۱۴. هم‌انباشتگی.....	۶۰۴
۸-۱۴. ناهمسانی واریانس شرطی خودرگرسیونی.....	۶۰۹
نکته.....	۶۱۳
مسائل.....	۶۱۴
منابع.....	۶۱۸

مقدمه

کتاب حاضر تحت عنوان *اقتصادسنجی* توسط یکی از معروف ترین اقتصادسنجان به نام بدی بالتاجی نوشته شده و تاکنون چندین بار مورد بازنگری و ویرایش قرار گرفته است. آخرین ویرایش این کتاب (ویرایش چهارم) مربوط به سال ۲۰۰۸ میلادی است. به عقیده بسیاری از استادان اقتصادسنجی به خصوص استادان کشورمان، این کتاب برای تدریس در مقطع کارشناسی ارشد بسیار مناسب بوده و حتی قابلیت معرفی به عنوان کتاب درسی در این مقطع را دارد.

طی سی سال گذشته تلاش های بسیاری برای ارتقای سطح دانش اقتصادسنجی در کشور شده است. کتاب های معروف بسیاری ترجمه و چند مورد کتاب اقتصادسنجی توسط اقتصادسنجان کشورمان به فارسی تألیف شده است. با این حال، عمده این ترجمه ها و تألیف ها برای مقطع کارشناسی بوده اند و برای سطوح تکمیلی در اقتصاد کفایت نمی کنند. به خصوص این که متن فارسی مناسبی برای تدریس در مقطع کارشناسی ارشد به زبان فارسی وجود ندارد که علاوه بر مرور اجمالی به پیش نیازها بپردازد تا حدی تمامی سرفصل های اصلی اقتصادسنجی را در سطح قابل قبولی پوشش دهد.

در پایان بر خود لازم می دانیم از افرادی که در ترجمه این کتاب از نکات آن ها استفاده شده است تشکر کنیم. از آقای سیروس امیدوار، خانم الهام خیراندیش و همچنین از استاد بزرگوار جناب آقای دکتر شاکری که تلاش بسیاری برای چاپ این کتاب داشتند تشکر و قدردانی می نماییم.