

حل المسائل اقتصادسنجی بالتاجی

مترجم: دکتر رضا طالبلو
(عضو هیئت علمی دانشگاه علامه طباطبائی)



شعری

سرشناسه	: بالتاجی، بادی اچ. (Baltagi, Badi H. (Badi Hani).
عنوان و نام پدیدآور	: حل المسائل اقتصادسنجی بالتاجی / ابادی هانی بالتاجی؛ مترجم رضا طالبلو.
مشخصات نشر	: تهران: نشر علم، ۱۳۹۲.
مشخصات ظاهری	: ۲۷۴ ص.
شابک	: ۹۷۸-۹۶۴-۲۲۴-۵۵۶-۷
وضعیت فهرست نویسی	: فیبا
یادداشت	: مترجم بخش هایی را به کتاب اصلی اضافه کرده است.
یادداشت	: کتاب حاضر قبلاً با عنوان "راهنمای مسائل اقتصادسنجی" توسط نشر سیمین در سال ۱۳۹۲ چاپ شده است.
عنوان دیگر	: راهنمای مسائل اقتصادسنجی.
موضوع	: اقتصادسنجی.
شناسه افزوده	: طالبلو، رضا، مترجم.
رده بندی کنگره	: HB۱۳۹/ب۲۲۲ ۱۳۹۲ : الف ۳۰/۵۱۹۵
رده بندی دیویی	: ۳۰/۵۱۹۵
شماره کتابشناسی ملی	: ۲۰۶۵۰۶



نشر

حل المسائل اقتصادسنجی بالتاجی

بادی اچ. بالتاجی

مترجم: رضا طالبلو

(عضو هیئت علمی دانشگاه علامه طباطبائی)

چاپ اول: ۱۳۹۲

تیراژ: ۱۱۰۰ نسخه

لینوگرافی: کوثر

چاپ: رامین

مرکز پخش علم: خیابان انقلاب، خیابان ۱۲ فروردین، خیابان شهدای ژاندارمری

بن بست گرانفر، پلاک ۴، تلفن ۶۶۴۱۲۳۵۸

حق چاپ برای ناشر محفوظ است.

شابک ۹۷۸-۹۶۴-۲۲۴-۵۵۶-۷

فهرست مطالب

۷	فصل اول: اقتصادسنجی چیست؟
۹	فصل دوم: مفاهیم آماری
۴۵	فصل سوم: رگرسیون خطی ساده
۶۳	فصل چهارم: تحلیل رگرسیون مرکب
۷۳	فصل پنجم: نقض فروض کلاسیک
۹۷	فصل ششم: الگوهای پویا و وقفه‌های توزیع شده
۱۰۵	فصل هفتم: الگوی خطی عمومی
۱۴۱	فصل هشتم: آزمون‌های تصریح و تشخیص رگرسیون
۱۶۳	فصل نهم: حداقل مربعات تعمیم یافته
۱۸۰	فصل دهم: رگرسیون‌های به ظاهر نامرتب
۱۹۳	فصل یازدهم: الگوی معادلات همزمان
۲۳۷	فصل دوازدهم: تلفیق داده‌های سری زمانی و مقطعی
۲۵۱	فصل سیزدهم: متغیرهای وابسته محدود شده
۲۵۹	فصل چهاردهم: تحلیل سری‌های زمانی

مقدمه

طی چهار دهه گذشته تلاش‌های بسیاری برای ارتقای سطح دانش اقتصادسنجی دانشجویان اقتصاد در دانشگاه‌های مختلف کشور صورت گرفته است و کتاب‌های معروف بسیاری ترجمه شده است و چند مورد کتاب اقتصادسنجی نیز توسط متخصصان اقتصاد سنجی در کشورمان به فارسی تالیف شده است. با این حال عمده این ترجمه‌ها و تالیف‌ها برای مقاطع کارشناسی بوده است و برای سطح تحصیلات تکمیلی در اقتصاد کفایت نمی‌کند به خصوص اینکه متن فارسی مناسب برای تدریس در مقطع کارشناسی ارشد و آمادگی دکتری به زبان فارسی بسیار محدود است.

کتابی تحت عنوان «اقتصادسنجی» توسط یکی از معروف‌ترین متخصصان اقتصادسنجی به نام بادی بالتاجی نوشته شده که در سال جاری ترجمه آن از توسط نشر نی منتشر شد. به عقیده بسیاری از استادان اقتصادسنجی این کتاب برای تدریس به عنوان کتاب درسی اصلی در مقطع کارشناسی ارشد بسیار مناسب است. از نظر مترجمین، کتاب مذکور چندین ویژگی دارد اول اینکه این کتاب تمامی موضوعات اساسی موردنیاز در اقتصادسنجی مقطع کارشناسی ارشد را در بر دارد. به علاوه افرادی که این کتاب را مطالعه می‌کنند با ادبیات کتاب «اقتصادسنجی داده‌های پانل» این نویسنده نیز آشنا می‌شوند چرا که فصل دوازدهم این کتاب در واقع خلاصه‌ای از فصول اولیه کتاب مذکور است. دوم اینکه در این کتاب بر آماره‌های آزمون اصلی در اقتصادسنجی یعنی آماره والد، نسبت درست نمایی و ضریب لاگرانژ به خوبی پرداخته است و به لحاظ مفهومی و کاربرد آن در حالات مختلف رگرسیونی پوشش مطالب این کتاب مطلوب به نظر می‌رسد. سومین ویژگی این کتاب مربوط به سوالات و تمرین‌های بسیاری است که در قالب اثبات، توضیح و تخمین ارائه شده است.

با توجه به اهمیت در دسترس بودن پاسخ به سوالات و تشریح آن‌ها در این کتاب به ترجمه پاسخ‌های این سوالات پرداخته شده است، امید است تا دانشجویان بتوانند از این اثر استفاده مطلوبی داشته باشند. در پایان بر خود لازم می‌دانم از تمامی دوستان و همکارانی که در تدوین این کتاب از نظرات آنان استفاده شده است به خصوص از آقای پویا قصوره به خاطر پیشنهادات ارزنده‌اشان تشکر می‌کنم و ضمناً از سرکار خانم لیلا حائری که در آماده‌سازی و صفحه‌آرایی این اثر تلاش بسیار نمودند قدردانی می‌نمایم. و همچنین از خوانندگان محترم تقاضا می‌شود در جهت ارتقای این اثر، نظرات و پیشنهادات خود را به آدرس پست الکترونیکی Talebloo.r@gmail.com ارسال نمایند.

فصل اول

اقتصاد سنجی چیست؟

در فصل اول تعریف اقتصادسنجی از نظر بزرگان اقتصاد سنجی ارایه شد که مهمترین آن‌ها عبارت است از:

در یک بیان کلی، اقتصاد سنجی به دنبال آن است که به روابط اقتصادی، محتوای تجربی دهد تا از این طریق نظریه‌های اقتصادی را آزمون کند و به پیش‌بینی، تصمیم‌سازی و ارزیابی سیاست یا تصمیم پس از اجرای آن بپردازد.

جی.ک، هورویتز و پسران^۱ (۲۰۰۷)

سپس جملاتی از اقتصاد سنجان در رابطه با این حوزه بیان شد به عنوان نمونه راگنار فریش که با ساختن اصطلاح *اقتصاد سنجی* معروف شد (کریست^۲ (۱۹۸۳)) بر این عقیده است که اقتصاد سنجی به دنبال این است که به روابط اقتصادی، محتوای تجربی دهد. سه عنصر کلیدی این روابط، نظریه اقتصادی، داده‌های اقتصادی و روش‌های آماری است. نظریه بدون اندازه‌گیری و اندازه‌گیری بدون نظریه برای تبیین پدیده‌های اقتصادی کافی نیست. همانطور که فریش تأکید کرد اجتماع آنها کلید موفقیت در توسعه آتی اقتصاد سنجی است.

لورنس کلین^۳ که به خاطر خلق الگوهای اقتصاد سنجی و کاربردهای آن، در تحلیل نوسانات اقتصادی و سیاست‌های اقتصادی برنده جایزه نوبل اقتصاد در ۱۹۸۰ شد، همیشه به تلفیق نظریه اقتصادی، روش‌های آماری و اقتصاد کاربردی تأکید کرده است. موضوع جالب در مورد اقتصاد سنجی، اهمیت قایل شدن به آن در تایید یا رد قوانین اقتصادی همچون؛ برابری قدرت خرید، فرضیه سیکل زندگی، نظریه مقداری پول و غیره است. این قوانین یا فرضیه‌های اقتصادی با

¹ J. Geweke, J. Horowitz, and M.H. Pesaran

² Christ

³ Lawrence Klein

داده‌های اقتصادی قابل آزمون هستند. دیوید اف. هندری^۴ (۱۹۸۰) در واقع بر این کارکرد اقتصادسنجی تأکید کرد:

سه قاعده طلایی اقتصادسنجی عبارتست از: آزمون، آزمون و آزمون
همچنین اقتصادسنجی تخمین‌های عددی از کشش‌های درآمدی و قیمتی تقاضا، تخمین‌هایی از بازده به مقیاس در تولید، کارایی فنی، سرعت گردش پول و غیره فراهم می‌کند. اقتصادسنجی همچنین در مورد نرخ‌های بهره آتی، بیکاری، یا رشد تولید ناخالص ملی، پیش‌بینی‌هایی را ارائه می‌کند.
در انتهای فصل نیز نظر جوک، هورویتز، و پسران (۲۰۰۷) در مورد آینده اقتصادسنجی آورده بیان شد:

اقتصادسنجی در نظریه و عمل، اطلاعات لازم برای تصمیم‌گیری آگاهانه را در سیاست‌های اقتصادی بخش خصوصی و عمومی فراهم می‌کند. این فرآیند نه تنها به دلیل عدم کفایت اقتصادسنجی، بلکه به واسطه توسعه نظریه اقتصادی و عدم کفایت داده‌ها و سایر اطلاعات دارای محدودیت می‌باشد. پیشرفت مؤثر در آینده همانند گذشته، از بهبودهای همزمان در اقتصادسنجی، نظریه اقتصادی و داده‌ها ناشی خواهد شد. تحقیقاتی که به صورت خاص بر مؤثر بودن ارتباط بین هر دو تا از این سه موضوع (اقتصادسنجی، نظریه‌های اقتصادی و داده‌ها) در بهبود سیاست‌سازی می‌پردازد، (تا چیزی در مورد همه آن‌ها نگوید) لزوماً مرزهای زیر شاخه‌های سنتی علم اقتصاد را تعالی می‌بخشد. اما دقیقاً ترکیب این سه است که برگزین نوید برای گسترده تر کردن مرزهای اقتصاد دانشگاهی است.

^۴ David F. Hendry