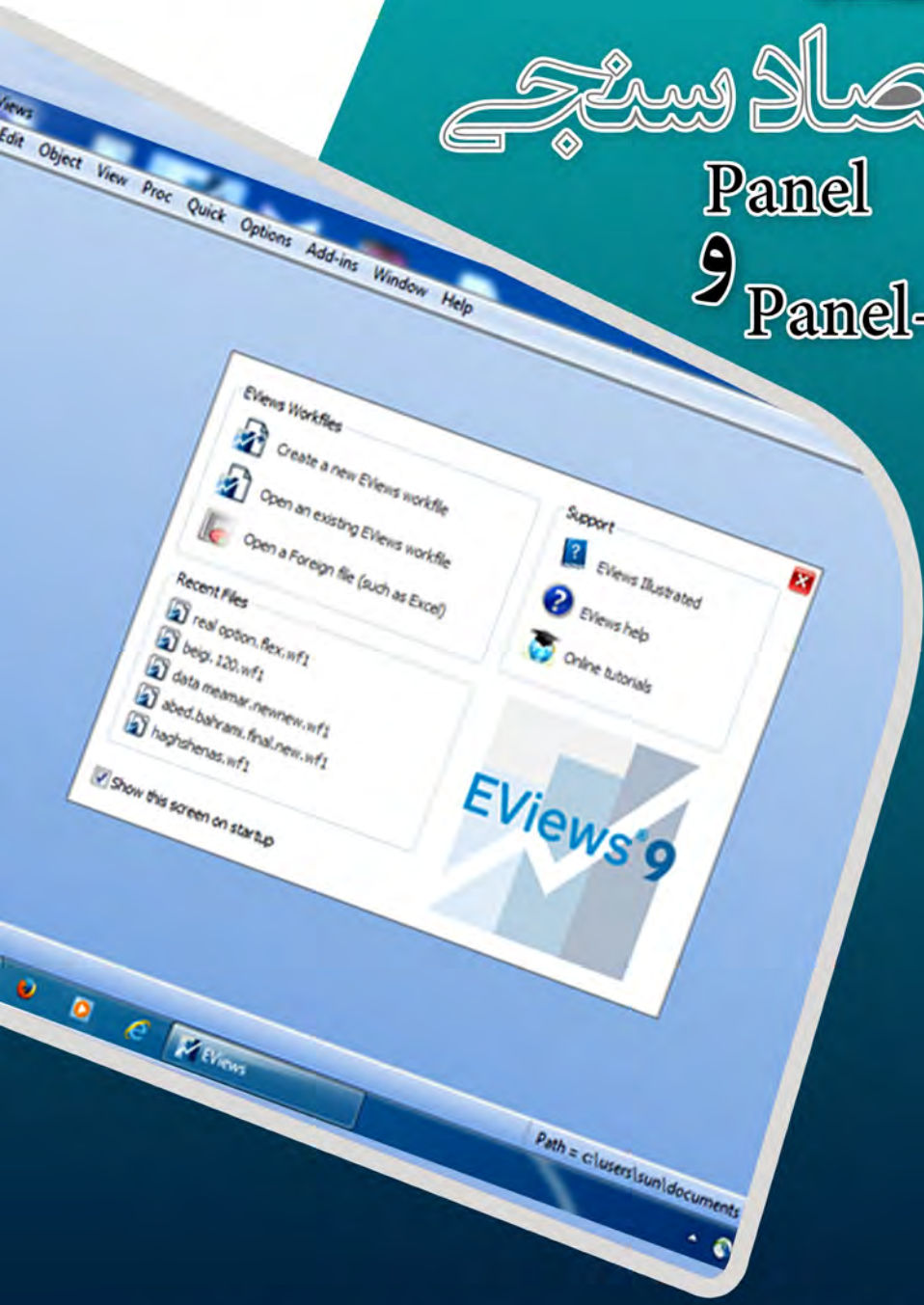


درآمدی بر

اقتصادسنجی

Panel و Panel-Var



بِسْمِ اللَّهِ الرَّحْمَنِ الرَّحِيمِ

درآمدی بر اقتصاد سنجی

Panel و Panel-Var

تالیف :

دکتر مصطفی حیدری هراتمه

عضو هیات علمی دانشگاه آزاد اسلامی

دکتر شمس اله شیرین بخش ماسوله

عضو هیات علمی دانشگاه آزاد اسلامی



انتشارات موجک



سرشناسه	: حیدری هراتمه، مصطفی، ۱۳۵۱.
عنوان و نام پدیدآور	: درآمدی بر اقتصادسنجی Panel و Panel-Var / تألیف دکتر مصطفی حیدری هراتمه، دکتر شمس اله شیرین بخش ماسوله.
مشخصات نشر	: تهران: انتشارات موجک، ۱۳۹۵.
مشخصات ظاهری	: ۹۲ ص؛ وزیری.
شابک	: ۸-۰۵-۸۶۳۴-۶۰۰-۹۷۸-۲۰۰۰۰۰ ریال.
وضعیت فهرست نویسی	: فیبا
یادداشت	: کتابنامه.
موضوع	: اقتصادسنجی
موضوع	: Econometrics
موضوع	: پیمایش پانلی -- الگوهای اقتصادسنجی
موضوع	: Panel analysis -- Econometric models
موضوع	: شیرین بخش، شمس الله
رده بندی کنگره	: ۱۳۹۵ د ۴ ح ۹ / HB
رده بندی دیویی	: ۳۳۰/۰۱۵۱۹۵
شماره کتابشناسی ملی	: ۴۴۳۳۷۴

انتشارات موجک

تلگرام: ۰۹۰۱۷۶۷۲۵۰۲ / telegram.me/mojak1
تلفن مرکز پخش: ۰۹۰۱۷۶۷۲۵۰۲ - ۰۲۱۶۶۱۲۷۵۹۳
Email : mojakpublication@yahoo.com
Web : www.mojak.ir



عنوان : درآمدی بر اقتصادسنجی Panel و Panel-Var

تألیف : دکتر مصطفی حیدری هراتمه، دکتر شمس اله شیرین بخش ماسوله

طراح جلد : سیده زهرا روشنایی

مشخصات ظاهری : ۹۲ صفحه، قطع وزیری

چاپ اول : بهار ۱۳۹۶

تیراژ : ۱۰۰۰ جلد - قیمت : ۲۰۰۰۰۰ ریال

شابک : ۸-۰۵-۸۶۳۴-۶۰۰-۹۷۸

حقوق چاپ و نشر برای ناشر محفوظ است.

فهرست مطالب

صفحه	عنوان
۱.....	فصل اول: مدل پانل (PANEL)
۱.....	۱-۱ مقدمه
۱.....	۲-۱ مفهوم پانل دیتا (PANEL DATA)
۲.....	۳-۱ الگوی رگرسیونی PANEL DATA
۲.....	۴-۱ مزایای PANEL DATA
۴.....	۵-۱ نحوه قرار گرفتن داده‌ها در PANEL DATA
۵.....	۶-۱ انتخاب میان داده‌های ادغام شده و داده‌های پنل
۵.....	۷-۱ تخمین مدل‌های رگرسیونی PANEL DATA
۷.....	فصل دوم: مدل پولینگ (POOLING)
۷.....	۱-۲ مدل کلی POOLING DATA
۸.....	۲-۲ روش‌های تخمین مدل (POOLING DATA) به روش اقتصادسنجی
۱۰.....	۳-۲ اثرات ثابت (FEM)
۱۱.....	۴-۲ اثرات تصادفی (ECM)
۱۱.....	۵-۲ انتخاب از بین FEM و ECM
۱۲.....	۶-۲ آزمون معنی دار بودن گروه
۱۲.....	۷-۲ آزمون هاسمن
۱۵.....	فصل سوم: مدل پانل ور (PANEL VAR)
۱۵.....	۱-۳ الگوی خودرگرسیون برداری پنل (PANEL - VAR)

۱۷.....	۲-۳ خودرگرسیون برداری در داده‌های پنل
۲۲.....	۳-۳ پایداری و مانایی
۲۶.....	۴-۳ شناسایی
۲۹.....	۵-۳ توابع واکنش آنی
۳۲.....	۶-۳ تجزیه واریانس
۳۴.....	۷-۳ تعیین طول وقفه بهینه در مدل‌های VAR
۳۴.....	۱-۷-۳ آزمون نسبت لایکلی هود
۳۵.....	۲-۷-۳ علیت گرنجر
۳۹.....	۸-۳ PANEL-VAR ساختاری
۴۵.....	۹-۳ واکنش آنی تعمیم یافته
۴۷.....	۱۰-۳ آزمون قطری بودن
۴۸.....	۱۱-۳ ویژگی‌های متمایز (PANEL-VAR) نسبت به (PANEL-DATA)
۵۴.....	۱۲-۳ معرفی روش آزمون MWD
۵۵.....	۱۳-۳ ترکیب داده‌های مقطعی و سری زمانی
۵۹.....	۱۴-۳ آزمون ناهمسانی واریانس
۵۹.....	۱۵-۳ آزمون علیت در برآورد داده‌های پنل
۶۰.....	۱۶-۳ آزمون ریشه واحد در برآورد داده‌های پنل

۶۱..... فصل چهارم: انجام الگوی پنل در ایویوز

۶۱.....	۱-۴ کار برگ فایل کاری
۶۱.....	۲-۴ کار برگ باز کردن معادله جهت تخمین
۶۲.....	۳-۴ کار برگ تصریح تخمین معادله
۶۲.....	۴-۴ کار برگ انتخاب گزینه‌های پنل (FIXED OR RANDOM)
۶۳.....	۵-۴ کار برگ تخمین رگرسیون پنل
۶۳.....	۶-۴ کار برگ آزمون چاو (F لیمر)

- ۶۴-۷ کار برگ خروجی آزمون چاو (F لیمر) ۶۴
- ۶۴-۸ کار برگ انتخاب گزینه اثرات تصادفی ۶۴
- ۶۵-۹ کار برگ خروجی رگرسیون پنل با اثرات تصادفی ۶۵
- ۶۵-۱۰ کار برگ آزمون هاسمن ۶۵
- ۶۶-۱۱ کار برگ خروجی آزمون هاسمن ۶۶
- ۶۶-۱۲ کار برگ تعیین اثرات ثابت یا تصادفی ۶۶
- ۶۷-۱۳ کار برگ تعیین اثرات ثابت مقاطع ۶۷
- ۶۷-۱۴ کار برگ خروجی اثرات ثابت مقاطع ۶۷
- ۶۸-۱۵ کار برگ تعیین اثرات دوره زمانی ۶۸
- ۶۸-۱۶ کار برگ خروجی اثرات تصادفی دوره زمانی ۶۸
- ۶۹-۱۷ کار برگ آزمون ایستایی پنل (ریشه واحد) ۶۹
- ۶۹-۱۸ کار برگ گزینه‌های آزمون ایستایی پنل (ریشه واحد) ۶۹
- ۷۰-۱۹ کار برگ گزینه‌های نوع آزمون ایستایی پنل (ریشه واحد) ۷۰
- ۷۰-۲۰ کار برگ خروجی آزمون ایستایی پنل (ریشه واحد) ۷۰
- ۷۱-۲۱ کار برگ آزمون‌های آمارهای توصیفی ۷۱
- ۷۱-۲۲ کار برگ آمارهای توصیفی ۷۱
- ۷۲-۲۳ کار برگ خروجی آزمون‌های آمارهای توصیفی ۷۲
- ۷۲-۲۴ کار برگ آزمون همگرایی پنل ۷۲
- ۷۳-۲۵ کار برگ نوع آزمون‌های همگرایی پنل ۷۳
- ۷۳-۲۶ کار برگ سه نوع آزمون‌های همگرایی پنل (پدرونی، کایو، فیشر) ۷۳
- ۷۴-۲۷ کار برگ خروجی آزمون همگرایی پنل پدرونی ۷۴
- ۷۴-۲۸ کار برگ خروجی آزمون همگرایی پنل KAO ۷۴
- ۷۵-۲۹ کار برگ معادله VAR در پنل ۷۵
- ۷۵-۳۰ کار برگ تصریح معادله VAR در پنل ۷۵
- ۷۶-۳۱ کار برگ خروجی الگوی VAR در پنل ۷۶

- ۳۲-۴ کار برگ تعیین طول وقفه الگوی VAR در پنل ۷۶
- ۳۳-۴ کار برگ خروجی تعیین طول وقفه الگوی VAR در پنل ۷۷
- ۳۴-۴ کار برگ واکنش آنی الگوی VAR در پنل ۷۷
- ۳۵-۴ کار برگ تعیین نوع واکنش آنی الگوی VAR در پنل ۷۸
- ۳۶-۴ کار برگ خروجی واکنش آنی الگوی VAR در پنل به صورت جدول ۷۸
- ۳۷-۴ کار برگ خروجی واکنش آنی الگوی VAR در پنل به صورت گراف ۷۹
- ۳۸-۴ کار برگ تجزیه واریانس الگوی VAR در پنل ۷۹
- ۳۹-۴ کار برگ تعیین نوع تجزیه واریانس الگوی VAR در پنل ۸۰
- ۴۰-۴ کار برگ تجزیه واریانس الگوی VAR در پنل به صورت جدول ۸۰
- ۴۱-۴ کار برگ تجزیه واریانس الگوی VAR در پنل به صورت گراف ۸۱
- ۴۲-۴ کار برگ آزمون همگرایی یوهانسن - جوسیلیوس ۸۱
- ۴۳-۴ کار برگ تصریح آزمون همگرایی یوهانسن - جوسیلیوس ۸۲
- ۴۴-۴ کار برگ خروجی آزمون همگرایی یوهانسن - جوسیلیوس ۸۲
- ۴۵-۴ کار برگ آزمون‌های مرتبط با پسماند (فروض کلاسیک) ۸۳
- ۴۶-۴ کار برگ آزمون خود همبستگی جمله خطا ۸۳
- ۴۷-۴ کار برگ خروجی آزمون خود همبستگی جمله خطا ۸۴
- ۴۸-۴ کار برگ خروجی آزمون ناهمسانی جمله خطا ۸۵
- ۴۹-۴ کار برگ آزمون نرمالیتی جمله خطا ۸۵
- ۵۰-۴ کار برگ آزمون نرمالیتی چند متغیره جمله خطا ۸۶
- ۵۱-۴ کار برگ خروجی آزمون نرمالیتی جمله خطا ۸۶
- ۵۲-۴ کار برگ تصریح الگوی VAR ۸۷
- ۵۳-۴ کار برگ خروجی تصریح الگوی VECM ۸۷
- ۵۴-۴ کار برگ تصریح الگوی VECM ۸۸
- ۵۵-۴ کار برگ خروجی تصریح الگوی VECM ۸۸
- ۵۶-۴ کار برگ تصریح الگوی BAYESIAN VAR ۸۹

- ۵۷-۴ کار برگ خروجی تصریح الگوی BAYESIAN VAR ۸۹
- ۵۸-۴ کار برگ تصریح الگوی VAR PRIOR ۹۰
- ۵۹-۴ کار برگ گزینه‌های تصریح الگوی VAR PRIOR ۹۰
- ۶۰-۴ کار برگ ایجاد سری جدید ۹۱
- ۶۱-۴ کار برگ گزینه‌های PROC ۹۱
- ۶۲-۴ کار برگ گزینه هی آجکت ۹۲

Panel & Panel-Var

اقتصاد سنجی یکی از شاخه‌های نوین و مهم علم اقتصاد می‌باشد که آشنایی و استفاده از آن می‌تواند کمک شایانی برای شناخت هر چه بهتر روابط بین پدیده‌های اقتصادی و اجتماعی باشد. بکارگیری این شاخه از علم اقتصاد در بررسی‌های اقتصادی و اجتماعی نیازمند آشنایی با ابزارهای کارآمدی همچون رایانه، نرم افزارهای رایانه‌ای، استفاده از داده‌های آماری قابل اعتماد می‌باشد. در واقع هدف اصلی در برنامه‌های رایانه‌ای، سرعت بخشیدن به محاسبات پیچیده فرمول‌ها و الگوهای اقتصاد سنجی است.

ISBN: 978-600-8634-05-8



9 786008

634058

