

۲۲۹۶۸۳۱



آموزش مصور مباحث کاربردی در اقتصاد سنجی (پانل دیتا)

www.ketab.ir

تألیف:

دکتر پروانه کمالی دهکردی (عضو هیأت علمی دانشگاه پیام نور)

عبدالخالق غبیشاوی، فرشته عبدالهی

پژوهشکده اقتصاد دانشگاه تربیت مدرس

سرشناسه	: کمالی دهکردی، پروانه، ۱۳۴۳.
عنوان و پدیدآور	: آموزش مصور مباحث کاربردی در اقتصاد سنجی (پانل دیتا) / تالیف: دکتر پروانه کمالی دهکردی، عبدالخالق غبیشاوی، فرشته عبدالمهی.
مشخصات نشر	: تهران. پژوهشکده اقتصاد دانشگاه تربیت مدرس.
مشخصات ظاهری	ص ۱۶۰، جدول، نمودار، مصور.
شابک	۹۷۸-۶۰۰-۱۶۹-۴۷۱-۴
فهرست نویسی	: براساس اطلاعات فیبا (فهرست نویسی پیش از انتشار).
یادداشت	عبدالمهی، فرشته، ۱۳۶۴، مولف.
یادداشت	: غبیشاوی، عبدالخالق، ۱۳۶۴، مولف
موضوع	: اقتصاد سنجی (برنامه های کامپیوتری).
موضوع	: اقتصاد سنجی - پانل دیتا
موضوع	: اقتصاد سنجی - پانل بیزین
رده بندی کنگره	: ۱۴۰۰ ف۲۸ / ک۱۳۹ HB
رده بندی دیویی	: ۳۳۰/۰۱۵

عنوان:	آموزش مصور مباحث کاربردی در اقتصاد سنجی (پانل دیتا)
تالیف:	دکتر پروانه کمالی دهکردی (عضو هیأت علمی دانشگاه پیام نور)، عبدالخالق غبیشاوی، فرشته عبدالمهی
ویراستار علمی:	دکتر فاطمه مهربانی
طراح روی جلد:	نازنین گرگی
ناشر:	پژوهشکده اقتصاد دانشگاه تربیت مدرس
شمارگان:	۵۰۰
شابک:	۹۷۸-۶۰۰-۱۶۹-۴۷۱-۴
نوبت چاپ:	اول ۱۴۰۱
چاپ و صحافی:	نصر
قیمت:	۶۰۰۰۰ تومان

آدرس: تهران - خ جلا آل احمد - دانشگاه تربیت مدرس پژوهشکده اقتصاد - ص پ - ۳۱۶-۱۴۱۱۵

تلفن ۸۲۸۸۳۹۰۱ دورنگار ۸۸۰۰۸۵۷۱ ایمیل res.edu@modares.ac.ir

وب سایت res.edu@modares.ac.ir

پیچیدگی زندگی بشر و تلاش وی در جستجوی واقعیت در علوم انسانی، استفاده از روش‌های پژوهش نوین را اجتناب ناپذیر کرده است. بعلاوه گسترش روابط و دل مشغولیهای بشر و عزم راسخ وی برای تسلط به متغیرهای محیط اطراف و کوشش برای کنترل متغیرهای تاثیر گذار بر زندگی فردی و اجتماعی می‌رود تا روز بروز نقش یافته‌های پژوهشی را در زندگی بارزتر نماید. در این راستا انسان بدنبال بهترین ابزار کار آمد جهت ارائه برون‌دادهای پژوهشی خود بوده است. در علوم انسانی و بویژه اقتصاد، مدیریت، حسابداری، علوم اجتماعی و جامعه شناسی، ریاضیات، آمار، سنجش و اندازه‌گیری و اقتصادسنجی به عنوان بهترین ابزار مطرح شده که استفاده روزافزون از این ابزار تقریباً در اکثر مطالعات و پژوهش‌های دانشگاهی بارز می‌باشد.

برای بکار گیری ابزارها و تکنیک‌های فوق دسترسی به آمار و اطلاعات از ضروریات اولیه می‌باشد حال بسته به نوع داده‌ای که برای پژوهش مورد نظر قابل دستیابی است انواع روش‌های مختلف وجود دارد.

ممکن است داده‌ها یا آمار مربوط به مقاطع در یک مقطع زمانی باشد مانند متوسط دمای کشور به تفکیک استانها و یا تعداد مبتلایان به ویروس کوید ۱۹ در ۲۲ تیرماه جاری به تفکیک استانهای ۳۱ گانه. روش مورد استفاده در تخمینهای اقتصادسنجی روش مقطعی است که مقاطع همان ۳۱ استان کشور می‌باشد. نوع دیگر داده‌ها، آمار در طول زمان برای مقطعی خاص مد نظر است مثلاً تعداد فوتیهای روزانه ناشی از ویروس کوید ۱۹ در کشور طی اردیبهشت ۱۳۹۹. ابزار این نوع داده‌ها، سری زمانی می‌باشد که در آمار و اقتصادسنجی تکنیک‌های مختلفی برای آن معرفی و استفاده می‌شود. سومین و مهمترین شکل داده‌های مورد استفاده "داده‌های ترکیبی یا پانل دیتا" است که ترکیبی از داده‌های مقطعی و سری زمانی بوده و نسبت به دو روش قبلی از امتیازات ویژه‌ای به شرح ذیل برخوردار است

- با ترکیب مشاهدات سری زمانی و مقطعی، داده‌های ترکیبی اطلاعات بیشتر، تغییر پذیری بیشتر، هم خطی کمتر میان متغیرها، درجات آزادی بیشتر و کارایی بیشتری را ارائه می‌کنند.

- در مطالعه مشاهدات مقطعی تکراری، داده‌های ترکیبی به منظور مطالعه پویای تغییرات مناسب تر و بهترند. بعبارتی دوره‌های بیکاری، چرخش شغلی و تحرک نیروی کار با داده‌های ترکیبی بهتر بررسی می‌شوند.

- داده‌های ترکیبی، تاثیراتی را که نمی‌توان به سادگی در داده‌های سری زمانی و مقطعی مشاهده کرد، بهتر بیان می‌کنند. برای مثال، اگر انحراف از واریانس افزایش حداقل دستمزد را در حداقل دستمزد بررسی کنیم، اثرات قوانین حداقل دستمزد را بر اشتغال و کسب درآمد بهتر می‌توان مطالعه کرد.

- داده‌های ترکیبی با ارائه داده برای هزاران واحد، می‌توانند تورشی را که ممکن است در نتیجه لحاظ افراد یا بنگاه‌های اقتصادی (به صورت جمعی و کلی) حاصل شود، به حداقل برسانند.

- از آنجا که داده‌های ترکیبی به افراد، بنگاه‌ها، شرکتها و کشورها و از این قبیل واحدها، در طی زمان ارتباط دارند؛ وجود ناهمسانی واریانس در این واحدها محدود می‌شود. بر همین اساس، پانل دیتا یکی از روش‌های پرکاربرد در اقتصادسنجی است که بسیاری از محققین و دانشجویان رشته‌های مدیریت، حسابداری و بخصوص اقتصاد، از آن در کارهای تحقیقاتی، مقالات و پایان‌نامه‌ها بهره می‌گیرند. از جمله نرم افزارهای مورد استفاده در پانل دیتا دو نرم افزار EViews، Stata و Matlab است. این مجموعه برآن است تا به زبانی ساده وبا استفاده از ۱۰ EViews، ۱۵ Stata و Matlab مراتب کار با پانل دیتا را از جوانب مختلف معرفی نموده تا محققین و دانشجویان بتوانند با تسلط کامل به کارهای پژوهشی عمیق و کاربردی بپردازند.

در پایان اگر چه گروه مولفین نهایت سعی خود را در تدوین مجموعه مبذول داشته اند اذعان میدارند که کار خالی از کاستی و اشکال نبوده و بسیار خرسند خواهند شد اگر شما خواننده گرامی نظریات اصلاحی و تکمیلی خود را به نویسندگان کتاب دریغ نفرمایید.

زمستان ۱۳۹۹

گروه مولفان

دکتر پروانه کمالی دهکردی (عضو هیأت علمی دانشگاه پیام نور)

عبدالخالق غبیشاوی - فرشته عبدالمهی

فهرست مطالب

پیشگفتار.....	۳
فصل اول: داده‌های پانل.....	۹
(۱-۱) مقدمه.....	۱۱
(۲-۱) وارد کردن داده‌ها و برآورد مدل پانل دیتا در نرم افزار ایویوز.....	۱۱
(۳-۱) برآورد مدل پانل دیتا در نرم افزار استاتا.....	۲۱
(۴-۱) آزمون‌های تکمیلی.....	۲۵
(۱-۴-۱) آزمون همبستگی مقطعی داده‌های پانلی.....	۲۵
(۲-۴-۱) آزمون ناهمسانی واریانس داده‌های پانل دیتا.....	۲۷
(۳-۴-۱) آزمون خودهمبستگی پانلی.....	۳۰
فصل دوم: مدل گشتاورهای تعمیم یافته (GMM).....	۳۳
(۱-۲) مقدمه.....	۳۵
(۲-۲) برآورد مدل گشتاورهای تعمیم یافته در نرم افزار استاتا.....	۳۵
(۳-۲) برآورد مدل گشتاورهای تعمیم یافته در نرم افزار ایویوز.....	۳۶
فصل سوم: پانل بیزین.....	۴۳
(۱-۳) مقدمه.....	۴۵
(۲-۳) برآورد مدل پانل بیزین در نرم افزار استاتا.....	۴۶
فصل چهارم: الگوی خود رگرسیون برداری داده‌های پانل.....	۵۱
(۱-۴) مقدمه.....	۵۳
(۲-۴) برآورد الگوی خود رگرسیون برداری داده‌های پانل در نرم افزار استاتا.....	۵۳
فصل پنجم: پانل دو طرفه.....	۵۹
(۱-۵) مقدمه.....	۶۱
(۲-۵) برآورد الگوی پانل دو طرفه در نرم افزار استاتا.....	۶۱
(۱-۲-۵) بررسی اثرات نامتجانس زمانی.....	۶۲

۶۴.....	۲-۲-۵) آزمون هاسمن.....
۶۷.....	فصل ششم: مدل رگرسیون انتقال ملایم پانلی (PSTAR).....
۶۹.....	۱-۶) مقدمه.....
۶۹.....	۲-۶) برآورد مدل رگرسیون انتقال ملایم پانلی در نرم افزار استاتا.....
۷۵.....	۳-۶) برآورد مدل رگرسیون انتقال ملایم پانلی در نرم افزار متلب.....
۸۱.....	فصل هفتم: الگوی خودرگرسیون توضیحی برای داده‌های پانل (Panel ARDL).....
۸۳.....	۱-۷) مقدمه.....
۸۳.....	۲-۷) برآورد الگوی خود رگرسیون توضیحی برای داده‌های پانل در استاتا.....
۸۹.....	۱-۲-۷) برآورد ضریب تصحیح خطا در مقاطع بصورت مجزا.....
۹۱.....	فصل هشتم: تخمین زنده حداقل مربعات پویا.....
۹۳.....	۱-۸) مقدمه.....
۹۳.....	۲-۸) برآورد الگوی تخمین زنده حداقل مربعات پویا در ایویوز.....
۹۶.....	۱-۲-۸) برآورد روش حداقل مربعات معمولی پویای پانلی (DOLS) در نرم افزار ایویوز.....
۹۹.....	۲-۲-۸) برآورد روش حداقل مربعات کاملاً اصلاح شده (FMOLS) در نرم افزار ایویوز.....
۱۰۳.....	فصل نهم: علیت تصحیح خطای برداری پانلی.....
۱۰۵.....	۱-۹) مقدمه.....
۱۰۵.....	۲-۹) برآورد الگوی تصحیح خطای برداری پانلی در نرم افزار ایویوز.....
۱۱۷.....	۳-۹) آزمون علیت تودا - یاماموتو (رابطه علیت میان متغیرها).....
۱۲۷.....	فصل دهم: پانل فضایی.....
۱۲۹.....	۱-۱۰) مقدمه.....
۱۲۹.....	۲-۱۰) ایجاد ماتریس مجاورت.....
۱۳۱.....	۳-۱۰) تشخیص همبستگی فضایی.....
۱۴۲.....	۴-۱۰) آزمون‌های تشخیص مدل.....
۱۴۴.....	معیار آکائیک و شوارتز مدل SDM.....
۱۴۴.....	معیار آکائیک و شوارتز مدل SAC.....