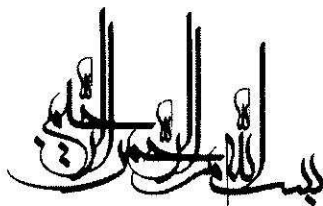


۹۷۸۶۵۴۳۲۱



اقتصادسنجی مدل‌های چرخش رژیم

(نظریه و کاربرد)

جلد اول: مدل‌های آستانه‌ای

نویسنده:

دکتر سید یحیی ابطحی

عضو هیات علمی دانشگاه آزاد اسلامی

سرشناسه	ابطحي، سيد يحيى، ۱۳۵۶.
عنوان و پديد آور	اقتصادسنجى مدل‌هاى چرخش رژيم (نظريه و کاربرد) جلد اول: مدل‌هاى آستانه‌اى، نويسنده: سيد يحيى ابطحي
مشخصات نشر	تهران: نور علم.
مشخصات ظاهرى	۱۹۴ ص.: نمودار.
شابک	دوره ۳-۵۰۶-۱۶۹-۶۰۰-۹۷۸: ج ۱. ۶-۵۰۵-۱۶۹-۶۰۰-۹۷۸
مشخصات ظاهرى	ج ۲: جدول، نمودار.
شناسه افزوده	امامى، كريم، ۱۳۴۳، ويراستار علمى.
موضوع	اقتصاد سنجى
موضوع	اقتصاد - الگوهاى رياضى
موضوع	اقتصاد -- روش‌هاى آمارى
رده بندى كنگره	HB ۱۳۹ :
رده بندى ديويى	۳۳۰/۰۱۵ :

نشر نورعلم: تهران- انقلاب- خ ۱۲ فروردين- پلاك ۲۹۰- تلفن: ۶۶۴۰۵۸۸۰ و ۶۶۹۵۷۰۲۱
 فروشگاه: خ ۱۲ فروردين- پلاك ۲۹۰- كتاب چرتكه و نورعلم- -- ۰۹۱۲۲۰۷۹۸۴۹ - ۰۶۶۱۷۴۹۱۰
 پخش: قلم سينا -انقلاب - ۱۲ فروردين- ساختمان ۲۸۶ واحد ۴ تلفن ۶۶۹۵۷۰۲۱ و ۶۶۹۵۷۱۲۰

عنوان: اقتصاد سنجى مدل‌هاى چرخش رژيم (نظريه و کاربرد)

جلد اول: مدل‌هاى آستانه‌اى

نويسنده: دكتور سيد يحيى ابطحي

ويراستار علمى: دكتور كريم امامى

ناشر: نور علم

شمارگان: ۲۰۰ جلد

شابک: ۶-۵۰۵-۱۶۹-۶۰۰-۹۷۸

نوبت چاپ: اول ۱۴۰۱

چاپ و صحافى: نصر

قيمت: ۹۵۰۰۰ تومان

در صورت عدم دسترسى به كتابها، از طريق تماس با شماره
 ۰۹۱۲۳۳۳۴۲۲۹ كتابها به تمام نقاط ايران ارسال مى شود.

طی دهه‌های اخیر، گرایش قابل توجهی در مدل‌سازی رفتار پویای متغیرهای کلان اقتصادی و مالی ایجاد شده است. اما یک چالش مهم برای مدل‌سازی رفتارهای پویا آن است که سری‌های زمانی به احتمال زیاد دستخوش تغییرات در رفتار خود در طول دوره مورد بررسی می‌شوند. در نتیجه علاقه زیادی از سوی اقتصادسنجی‌دانان به طراحی مدل‌هایی که بتواند چنین رفتاری را مدل‌سازی کند، نشان داده شده است. برای مثال، بازارهای مالی اغلب رفتار خود را به طور ناگهانی تغییر می‌دهند. و تغییر رفتار قیمت دارایی‌ها برای بسیاری از دوره‌ها ادامه می‌یابد. به عنوان یک نمونه مشخص، الگوهای میانگین، نوسانات و همبستگی در بازده سهام در آغاز بحران مالی جهانی ۲۰۰۸-۲۰۰۹ به طور چشمگیری تغییر کرد و تا پایان آن ادامه یافت. به طور مشابه، تغییرات در رژیم‌ها، که برخی از آن‌ها می‌تواند تکرار شوند (مانند دوره‌های بولی در مقابل رکود) و برخی از آن‌ها می‌تواند منحصر به فرد باشند و به عنوان شکست در رفتار سری تلقی شوند در رفتار بسیاری از متغیرهای کلان رایج است. یک رهیافت مناسب برای مدل‌سازی چنین رفتارهایی، رهیافت چرخش رژیم است که به محقق اجازه می‌دهد تغییرات رفتار متغیر سری زمانی را در دوره‌های زمانی گوناگون و با رژیم‌های متفاوت، مدل‌سازی کند.

امروزه رهیافت تغییر در رژیم یا چرخش رژیم در مباحث سری‌های زمانی بسیار گسترده شده است. طی سال‌های اخیر مطالعات بسیاری نیز در این حوزه در داخل کشور انجام شده است که به دلیل ماهیت پیچیده مدل‌های غیرخطی و عدم دسترسی پژوهشگران به یک منبع منسجم و فارسی در این خصوص، برخی از مطالعات از اشکالاتی در آزمون‌ها، نحوه مدل‌سازی و تفسیر نتایج این مدل‌ها برخوردار بوده‌اند. این موضوع انگیزه‌ای شد تا مطالعاتی گسترده‌ای را که طی سال‌های گذشته در این حوزه و از منابع معتبر اقتصادسنجی داشته‌ام جمع‌آوری کنم. هدف از ارائه این کتاب ارائه مجموعه‌ای از مباحث نظری و کاربرد

مدل‌های چرخش رژیم است و تلاش شده است تا با ارائه هر آزمون یا مدلی در هر بخش مثالی از متغیرهای کلان اقتصادی و مالی و روابط پویای آن‌ها در حوزه اقتصاد ایران آورده شود. این مثال‌ها در قالب نمایه‌های ارائه‌شده در هر بخش آورده شده است و خواننده می‌تواند با انجام همین فرآیند و جایگزین کردن داده‌های خود به‌جای داده‌های هر مثال با نحوه انجام آزمون‌های غیرخطی و برآورده مدل‌های چرخش رژیم آشنا شود. به دلیل قابلیت‌های گسترده نرم‌افزار R، در این کتاب بسته‌های تهیه‌شده در این نرم‌افزار که به‌منظور آزمون‌های غیرخطی یا برآورد مدل‌های چرخش رژیم طراحی شده‌اند بکار رفته است. در کاربرد مدل‌های پنل آستانه‌ای در فصل ششم، از نرم‌افزار STATA به دلیل قابلیت‌های ویژه این نرم‌افزار در تحلیل داده‌های پنل استفاده شده است.

نظر به ماهیت مدل‌های چرخش رژیم و پیچیدگی‌هایی که در روش‌های آماری غیرخطی وجود دارد مطالعه این کتاب نیازمند آشنایی با تحلیل‌های سری زمانی است و انتظار می‌رود که خواننده با مفاهیم اولیه سری‌های زمانی مانند ایستایی، توابع خودهمبستگی، فرایندهای گام تصادفی و... و همچنین مدل‌های خودرگرسیون میانگین متحرک (ARMA)، خودرگرسیون برداری (VAR) و مباحث همجمله و تحلیل داده‌های پنل آشنا باشد در غیر این صورت، برای مطالعه‌ی هر بخش لازم است خواننده ابتدا به منابعی که پیش‌زمینه‌ای از بحث مورد اشاره را فراهم می‌کنند رجوع کند.

با توجه به گستردگی مباحث، جلد اول این کتاب صرفاً به مباحث مدل‌های آستانه‌ای در حوزه مدل‌های تک متغیره و چند متغیره و داده‌های پنل اختصاص یافته است و مباحث مربوط به مدل‌های انتقال هموار و چرخش رژیم مارکوف در جلد دیگری آورده می‌شود.

در تهیه این کتاب از منابع متعددی بهره گرفته شده است اما بنا به ماهیت زمینه مورد بحث و پیچیدگی‌های مدل‌های غیرخطی بدون شک مطالب کتاب می‌تواند از نواقص و کاستی‌هایی برخوردار باشد. لذا از کلیه خوانندگان و صاحب‌نظران درخواست می‌کنم که

هرگونه سؤال، پیشنهاد و یا موارد مربوط به کاستی‌های مطالب کتاب را به ایمیل Abtahi@iauyazd.ac.ir ارسال کنند. بر خود لازم می‌دانم از راهنمایی‌های ارزنده برخی متخصصان آمار و اقتصادسنجی سری‌های زمانی همچون پروفسور دیک ون دیک و بروس هنسن که از طریق پاسخ‌گویی به سوال‌ها در خصوص برخی از موارد بنده را راهنمایی کرده‌اند قدردانی کنم. در خاتمه لازم می‌دانم از همسر و فرزندانم که با صبر و بردباری خود در امر نگارش این کتاب مرا یاری نموده‌اند سپاسگزاری کنم.

سید یحیی ابطحی

عضو هیأت علمی گروه مهندسی مالی

دانشگاه آزاد اسلامی واحد یزد

www.ketab.ir

فهرست مطالب

فصل اول: مقدمه.....	۱۱
فصل دوم: کاوشی در رفتار غیرخطی سربهای زمانی.....	۲۲
۱.۲ مقدمه.....	۲۲
۲.۲ تحلیل نموداری رفتار غیرخطی: نمودار پراکنش و رگرسیون با وقفه.....	۲۳
۱.۲.۲ مثال (۱-۲): نمودار پراکنش و رگرسیونهای باوقفه <i>Lynx</i>	۲۵
۳.۲ آزمونهای غیرخطی بودن.....	۲۸
۱.۳.۲ آزمونهای ناپارامتری.....	۲۸
۱.۱.۳.۲ آزمونهای زمان-برگشت پذیری.....	۲۸
۲.۱.۳.۲ آزمون <i>BDS</i>	۳۳
۳.۱.۳.۲ آماره <i>Q</i> مجذور پسماندها: آزمون مک لئود و لی.....	۳۹
۴.۱.۳.۲ آزمون پنا-رودریگر.....	۴۱
۲.۳.۲ آزمونهای پارامتری.....	۴۳
۱.۲.۳.۲ آزمون <i>RESET</i>	۴۴
۲.۲.۳.۲ آزمون کینان.....	۴۵
۳.۲.۳.۲ آزمون تسی.....	۴۷
۳.۳.۲ آزمون غیرخطی بودن با استفاده از شبکههای عصبی مصنوعی (ANN): آزمونهای	
وایت (۱۹۸۹) و تراسویرتا، لین و گرنجر (۱۹۹۳).....	۴۹
۴.۲ اجرای همزمان آزمونهای غیرخطی بودن.....	۵۱
فصل سوم: خودرگرسیون آستانه‌ای.....	۵۳
۱.۳ معرفی مدل‌های خودرگرسیون آستانه‌ای.....	۵۳
۲.۳ کالبد یک مدل <i>TAR</i>	۵۶
۳.۳ تعادل و جذب کننده در مدل‌های <i>TAR</i>	۵۷
۴.۳ ایستایی مدل‌های <i>TAR</i>	۶۰
۵.۳ آزمونهای غیرخطی بودن از نوع آستانه‌ای.....	۶۶
۱.۵.۳ آزمون نسبت درستنمایی (LR).....	۶۶
۲.۵.۳ آزمون تسی.....	۶۹

۷۳	۳.۵.۳ آزمون همزمان غیرخطی آستانه‌ای و ایستایی: آزمون کانر و هسن
۷۵	۴.۵.۳ آزمون بک، بن سالم و کاراسکو (BBC)
۸۰	۶.۳ برآورد مدل‌های خودرگرسیون آستانه‌ای
۸۱	۷.۳ مدل‌سازی TAR
۸۷	۸.۳ برآورد مدل خودرگرسیون آستانه‌ای (خودمحرک) ext
۹۰	۹.۳ مدل‌سازی TAR در بسته TSA
۹۲	۱۰.۳ عارضه‌یابی مدل‌های TAR
۹۲	۱۱.۱۰.۳ تحلیل کالبد
۹۳	۲.۱۰.۳ آزمون ترکیبی تعمیم‌یافته
۹۷	۱۱.۳ پیش‌بینی مدل‌های TAR
۱۰۰	فصل چهارم: خودرگرسیون برداری آستانه‌ای
۱۰۰	۱.۲ مقدمه
۱۰۲	۲.۴ معرفی مدل خودرگرسیون برداری آستانه‌ای
۱۰۳	۳.۴ برآورد مدل خودرگرسیون برداری آستانه‌ای
۱۰۵	۴.۴ آزمون خطی بودن
۱۰۶	۱.۴.۴ آزمون لو و زیووت
۱۰۶	۵.۴ فاصله اطمینان برای آستانه
۱۰۷	۶.۴ تشخیص تعداد رژیم‌ها و وقفه‌ها
۱۰۸	۷.۴ توابع ضربه-واکنش
۱۱۱	۸.۴ شبیه‌سازی یک مدل TVAR
۱۱۷	۹.۴ برآورد یک مدل TVAR
۱۲۵	فصل پنجم: همجمعی آستانه‌ای
۱۲۵	۱.۵ مقدمه
۱۲۷	۲.۵ مدل همجمعی آستانه‌ای اندرز و سیکلوز
۱۲۷	۱.۲.۵ مروری بر آزمون همجمعی انگل-گرنجر و بیان تصحیح خطا
۱۲۸	۲.۲.۵ آزمون همجمعی اندرز و سیکلوز
۱۳۲	۳.۵ تصریح همجمعی آستانه‌ای گرنجر و لی

۱۳۳	۴.۵ مثال (۵-۱): روابط همجمعی بین سطح قیمت‌ها و نرخ ارز
۱۳۶	۱.۴.۵ نتایج تحلیل‌های همجمعی خطی
۱۳۶	۱.۱.۴.۵ آزمون همجمعی یوهانسن
۱۳۸	۲.۱.۴.۵ آزمون همجمعی انگل - گرنجر
۱۴۲	۲.۴.۵ تحلیل‌های همجمعی آستانه‌ای
۱۴۸	۳.۴.۵ برآورد مدل همجمعی آستانه‌ای گرنجر و لی (۱۹۸۹)
۱۵۳	۵.۵ مدل تصحیح خطای برداری آستانه‌ای هنسن و سئو
۱۵۶	۶.۵ آزمون فرضیه صفر خطی بودن با وجود عدم همجمعی
۱۵۸	۷.۵ مثال (۵-۲): همجمعی آستانه‌ای بین قیمت کالاها و قیمت خدمات
۱۶۹	فصل ششم: پل آستانه‌ای
۱۶۹	۱.۶ مقدمه
۱۷۰	۲.۶ معرفی مدل
۱۷۱	۳.۶ برآورد مدل
۱۷۳	۴.۶ آزمون وجود آستانه
۱۷۵	۵.۶ آستانه‌های چندگانه
۱۷۵	۱.۵.۶ برآورد مدل دو آستانه‌ای
۱۷۷	۲.۵.۶ تعیین تعداد آستانه‌ها
۱۸۸	منابع