



دانشگاه سمنان

مقدمه‌ای بر اقتصادسنجی

(تحلیل سری زمانی و مدل‌های پانل دیتا)

مترجم:

دکتر مجید مداح

عضویت علمی دانشگاه سمنان

سرشناسه :کوپ، گری Koop, Gary

عنوان و نام پدیدآور :مقدمه‌ای بر اقتصادسنجی: (تحلیل سری زمانی و مدل‌های پانل دیتا) / تألیف گری کوپ؛ مترجم مجید مداح.

مشخصات نشر :سمنان: دانشگاه سمنان، ۱۳۹۰.

مشخصات ظاهری :بی، ۱۶۵ ص: جدول، نمودار.

شابک : ۹۷۸-۶۰۰-۵۹۴۰-۴۲-۸

وضعیت فهرست نویسی :فیبیا

یادداشت :کتاب حاضر ترجمه بخشی از کتاب Introduction to econometrics, c2008 است .
یادداشت :واژه‌نامه.

موضوع :اقتصادسنجی شناسه افزوده :مداح، مجید، ۱۳۵۰ - مترجم
شناسه افزوده :دانشگاه سمنان

رده بندی کنگره :۱۳۹۰ م۷/ک۹/۱۳۹۰ HB

رده بندی دیویی :۱۵۱۹۵:۳۳۰/۱

شماره کتابشناسی ملی :۲۵۸۲۱۹۹



دانشگاه سمنان

مقدمه ای بر اقتصاد سنجی (تحلیل سری زمانی و مدل‌های پانل دیتا)

- مترجم : دکتر مجید مداح
- ویراستار علمی: دکتر نادر مهرگان، دانشیار دانشگاه بوعلی سینا
- ویراستار ادبی: دکتر حمید رضا زاده توکلی، استادیار دانشگاه سمنان
- طرح روی جلد و صفحه آرائی: اسماعیل شجاعی
- نوبت چاپ : اول - ۱۳۹۰
- چاپ : نفیس سمنان
- شمارگان : ۲۰۰ جلد
- قیمت : ۵۲۰۰۰ ریال

شابک : ۹۷۸-۶۰۰-۵۹۴۰-۴۲-۸

حق چاپ محفوظ و متعلق به انتشارات دانشگاه سمنان می باشد.
تلفن انتشارات: ۰۲۳۱-۳۳۲۰۲۹۵

فهرست مطالب

صفحه	فهرست
ح	پیشگفتار
۳	۱- تحلیل سری زمانی یک متغیره.....
۳	۱-۱- مقدمه.....
۶	۱-۲- علایم سری زمانی.....
۱۰	۱-۳- روندها در متغیرهای سری زمانی.....
۱۴	۱-۴- تابع خودهمبستگی.....
۱۷	۱-۵- مدل خودرگرسیون.....
۱۷	۱-۵-۱- مدل $AR(1)$
۲۳	۱-۵-۲- توسعه مدل $AR(1)$
۳۹	۱-۶- تعریف مانایی.....
۴۱	۱-۷- مدل‌هایی با نوسان پذیری.....
۴۲	۱-۷-۱- مقدمه‌ای بر نوسان‌پذیری در قیمت دارایی‌ها.....
۴۹	۱-۷-۲- ناهمسانی شرطی خودرگرسیون ($ARCH$).....
۵۳	۱-۷-۲-۱- توسعه مدل‌های $ARCH$
۵۵	ضمیمه: مدل‌های MA و $ARMA$
۶۱	۲- رگرسیون با متغیرهای سری زمانی.....
۶۱	۲-۱- مقدمه.....
۶۳	۲-۲- رگرسیون سری زمانی با X و Y مانا.....
۶۸	۲-۳- رگرسیون سری زمانی با X و Y نامانا.....
۶۸	۲-۳-۱- رگرسیون کاذب.....
۶۹	۲-۳-۲- هم‌انباشتگی.....
۷۳	۲-۳-۳- تخمین و آزمون هم‌انباشتگی.....
۷۳	۲-۳-۴- رگرسیون سری زمانی با وجود هم‌انباشتگی میان X و Y : مدل
۷۹	تصحیح خطا.....

۲-۴- رگرسیون سری زمانی وقتی X و Y ریشه واحد دارند اما هم‌انباشته

- ۸۴ نیستند
- ۸۶ ۲-۵- علیت گرانجر
- ۸۷ ۲-۵-۱- علیت گرانجر در مدل ADL
- ۹۴ ۲-۵-۲- علیت گرانجر با متغیرهای هم‌انباشته
- ۹۵ ۲-۶- خودرگرسیون برداری
- ۱۰۳ ۲-۶-۱- پیش‌بینی با مدل‌های VAR
- ۱۰۸ ۲-۶-۲- مدل VAR با متغیرهای هم‌انباشته
- ۱۱۲ ۲-۶-۳- تابع واکنش آنی و تجزیه واریانس در مدل‌های VAR
- ۱۲۱ ۳- مدل‌های پانل دیتا
- ۱۲۱ ۳-۱- مقدمه
- ۱۲۲ ۳-۲- مدل تلفیقی
- ۱۲۳ ۳-۳- مدل‌های اثرات فردی
- ۱۲۷ ۳-۳-۱- مدل اثرات ثابت
- ۱۳۲ ۳-۳-۲- مدل اثرات تصادفی
- ۱۴۲ ۳-۳-۳- تعمیم مدل‌های اثرات فردی
- ۱۴۶ واژه‌نامه انگلیسی به فارسی

پیشگفتار

طی سال‌های تدریس اقتصاد در دانشگاه دیده‌ام که همواره دانشجویان عزیز دغدغه انجام کار تجربی مبتنی بر تئوری‌های اقتصادی را دارند. یکی از مهمترین ابزارهایی که به مطالعه تجربی تئوری‌ها کمک می‌کند، استفاده از ابزارهای اقتصادسنجی است. اقتصادسنجی ترکیبی از تئوری‌های اقتصادی، آمار و ریاضیات است. تلفیق مفاهیم اقتصادی با مدل‌های ریاضی و ابزار آماری موجب جذابیت این درس شده است که این موضوع همواره از سوی دانشجویان اقتصاد، مدیریت و در سال‌های اخیر ریاضیات مالی مطرح شده است.

پس از نگارش کتاب اصول اقتصادسنجی که عمده‌تاً برای دانشجویان دوره کارشناسی ارائه می‌شود، در پی تکمیل موضوعات کتاب از طریق مباحث اقتصادسنجی پیشرفته بودم که به هنگام ارائه این درس برای دانشجویان ریاضیات مالی در دوره کارشناسی ارشد به کتاب مقدمه‌ای بر اقتصادسنجی نوشته گری کوپ برخورد نمودم. یکی از مهمترین ویژگی‌های این کتاب، بیان ساده مفاهیم پیشرفته اقتصادسنجی به دور از مدل‌های پیچیده و با استفاده از روش‌های ساده که قابل درک توسط تمامی دانشجویان گرامی در رشته‌های مختلف مالی است. کتاب حاضر ترجمه بخشی از این کتاب است که موضوعات تحلیل سری زمانی تک متغیره، رگرسیون با متغیرهای سری‌زمانی و پانل دیتا را در بر می‌گیرد. اغلب مطالعات تجربی انجام شده در حوزه اقتصاد و مباحث مالی با تکیه بر تحلیل سری زمانی و پانل دیتا انجام می‌شود که با مطالعه و فراگیری این کتاب، دانشجویان گرامی قادر به تخمین و تحلیل مدل‌های اقتصادسنجی پیشرفته فارغ از دغدغه‌های معمول تئوریک در مباحث اقتصادسنجی پیشرفته هستند.

خداوند منان را شاکرم که فرصت و توان ترجمه این کتاب را به من ارزانی داشت تا از این طریق بتوانم سهمی در پیشرفت علمی کشور داشته باشم. امیدوارم این یافته علمی مورد استفاده اساتید و دانشجویان گرامی قرار گیرد و کماکان بتوانم از نظرات این عزیزان بهره‌مند گردم.

از تمامی کسانی که در مراحل مختلف کتاب با من همراهی نمودند به ویژه همسر و فرزندان گرامی که از وقت متعلق به آنان استفاده نمودم، معاونت محترم پژوهشی دانشگاه سمنان و کارکنان ارجمند این حوزه که چاپ کتاب بدون حمایت آنان میسر نبود و دانشجویان عزیز به ویژه خانم نگین بازارچه شبستری که همواره مشوقم بوده‌اند، تقدیر و تشکر می‌نمایم.

این همه گفتیم لیک اندر بسیج
بی عنایات خدا هیچیم هیچ
بی عنایات حق و خاصان حق
گر ملک باشد سیا هستش ورق

مجید مداح

دانشگاه سمنان - دانشکده اقتصاد، مدیریت و علوم اداری

آبان ۱۳۹۰

Maddah50m@yahoo.com

www.ketab.ir