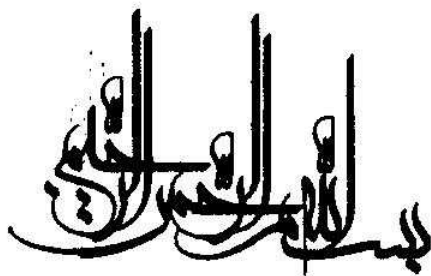


۱۴۷۵۵۵۸



اقتصاد سنجی کاربردی نری های زمانی

نویسندگان:
هنرموت لوتنه
مارکوس کریزیش

مترجمین:

دکتر شمس اله شیرین بخش ماسوله
(عضو هیات علمی دانشگاه الزهراء)
دکتر مریم مقدس بیات

۱۵۵۵۵۵۵۵

سرشناسه	لوتکه پل، هلموت، Lutkepohl H.
عنوان و پدیدآور	اقتصادسنجی کاربردی سری های زمانی / نویسندگان: هلموت لوتکه پل و مارکوس کرتزیش مترجمین: دکتر شمس اله شیرین بخش ماسوله - دکتر مریم مقدس بیات.
مشخصات نشر	: نور علم، ۱۳۹۵.
مشخصات ظاهری	: ۳۹۴ ص. جدول، نمودار، مصور.
شابک	: ۹۷۸-۶۰۰-۱۶۹-۲۲۵-۳
وضعیت فهرست نویسی	: براساس اطلاعات فیبا (فهرست نویسی پیش از انتشار).
یادداشت	عنوان اصلی: Applied time series econometrics
موضوع	: اقتصادسنجی کاربردی.
موضوع	: اقتصادسنجی سری های زمانی.
موضوع	: اقتصادسنجی -- برنامه های کامپیوتری.
شناسه اف رده	: شیرین بخش ماسوله ، شمس اله، ۱۳۳۱، مترجم.
شناسه افزودن	: مقدس بیات، مریم، ۱۳۵۱، مترجم.
رده بندی کنگر	۱۳۵۱ الف ۱۶۸ / ج ۱۳۹ HC
رده بندی دیویی	: ۳۲ / ۰۱۲

نشر نور علم: تهران - خ انقلاب - ۱۲ - پلاک ۲۵۹ - ط ۴ - واحد ۸ تلفن: ۶۶۴۰۵۸۹۴ و ۶۶۴۰۵۸۸۰
 noreelm@yahoo.com ۰۹۱ ۳۳ ۴۲۱۱ فروشگاه در تهران: دانشکده اقتصاد دانشگاه تهران

اقتصادسنجی کاربردی سری های زمانی

نویسندگان: هلموت لوتکه پل - مارکوس کرتزیش

مترجمین: دکتر شمس اله شیرین بخش ماسوله - دکتر مریم مقدس بیات

ناشر: نور علم

شمارگان: ۵۰۰ جلد

شابک: ۹۷۸-۶۰۰-۱۶۹-۲۲۵-۳

نوبت چاپ: اول ۱۳۹۵

چاپ و صحافی: الغدیر

قیمت: ۲۵۰۰۰ تومان

موبایل کار: در صورت عدم دسترسی به کتابهای این انتشارات، از طریق تماس با شماره زیر
 ۰۹۱۲۳۳۳۴۲۲۹ کتابها با پست به تمام نقاط ایران ارسال می شود.

فصل اول: مطالب اولیه و مرور کلی

۱	۱-۱ مقدمه
۲	۲-۱ طرح چارچوب اقتصادسنجی
۳	۳-۱ جمع آوری داده ها
۵	۴-۱ مدیریت داده ها
۶	۵-۱ تئوس مطالب فصول

فصل دوم: تعاریف سری های زمانی تک متغیره

۱۱	۲-۱ ویژگی های سری های زمانی
۱۵	۲-۲ ایستایی و فرایند تصادفی ناایستا
۱۵	۲-۲-۱ ایستایی
۱۷	۲-۲-۲ خود همبستگی های کوتاه جرنی و جنگالی طیفی
۲۵	۲-۲-۳ تبدیل داده ها و پالایش
۳۲	۲-۳ برخی الگوهای مرسوم سری های زمانی
۳۲	۲-۳-۱ فرایندهای خودبازگشت
۳۷	۲-۳-۲ فرایندهای میانگین متحرک با مرتبه محدود
۴۰	۲-۳-۳ فرایندهای ARIMA
۴۱	۲-۳-۴ ناهمسانی واریانس شرطی خودبازگشت
۴۴	۲-۳-۵ اجزاء قطعی
۴۵	۲-۴ برآورد پارامتر
۴۵	۲-۴-۱ برآورد الگوهای AR
۴۷	۲-۴-۲ برآورد الگوهای ARMA
۴۸	۲-۵ تبیین الگو
۴۸	۲-۵-۱ معیار تبیین مرتبه AR
۵۰	۲-۵-۲ تبیین الگوهای عمومی تر
۵۷	۲-۶ ارزیابی الگو
۵۷	۲-۶-۱ تحلیل توصیفی پسماندها

۶۲	۲-۶-۲ آزمون های تشخیصی جملات پسماند
۶۸	۲-۶-۳ تحلیل پایداری
۷۶	۲-۷-۱ آزمون های ریشه واحد
۷۷	۲-۷-۱ آزمون دیکی فولر تعمیم یافته
۸۰	۲-۷-۲ آزمون اشمیت-فیلیس
۸۲	۲-۷-۳ آزمون تغییر سطح
۸۸	۲-۷-۴ آزمون KPSS
۹۲	۲-۷-۵ آزمون های ریشه واحد فصلی
۹۹	۲-۸ پیش بینی در الگوهای سری زمانی تک متغیره
۱۰۲	۲-۹ مثال ها
۱۰۳	۲-۹-۱ سری زمانی مصرف در بر آلمان
۱۱۲	۲-۹-۲ بهره وری لهستان
۱۲۰	۲-۱۰ مباحث بعدی
	فصل سوم: الگوهای خودبازگشت برداری و تصحیح خطای برداری
۱۲۳	۳-۱ مقدمه
۱۲۵	۳-۲ الگوهای VAR و VECM
۱۲۶	۳-۲-۱ الگوها
۱۲۹	۳-۲-۲ اجزاء قطعی
۱۳۰	۳-۲-۳ متغیرهای برون زا
۱۳۲	۳-۳ برآورد
۱۳۲	۳-۳-۱ برآورد الگوی VAR نامقید
۱۳۶	۳-۳-۲ برآورد الگوی VECM
۱۴۷	۳-۳-۳ مقید نمودن جزء تصحیح خطا
۱۵۱	۳-۳-۴ برآورد الگوها با قیود عمومی بیشتر و فرم های ساختاری
۱۵۳	۳-۴ تبیین الگو
۱۵۳	۳-۴-۱ تعیین مرتبه خودبازگشت
۱۵۵	۳-۴-۲ تبیین مرتبه همگرایی

۱۶۶	۳-۴-۳ انتخاب جزء قطعی
۱۶۸	۳-۴-۴ آزمون قیود مربوط به بردار همگرایی و ماتریس بار
۱۶۹	۳-۴-۵ آزمون قیود پارامترهای کوتاه مدت و برآورد زیرالگوها
۱۷۲	۳-۵-۱ ارزیابی الگو
۱۷۲	۳-۵-۱ تحلیل توصیفی پسماندها
۱۷۵	۳-۵-۲ آزمون های تشخیصی
۱۸۰	۳-۵-۳ تحلیل پایداری
۱۹۲	۳-۶-۱ پیش بینی فواید های VAR و VECM
۱۹۲	۳-۶-۱ افراین های ساخته شده
۱۹۵	۳-۶-۲ افرایندهای برآورد
۱۹۸	۳-۷-۱ تحلیل علّیت گرنج
۱۹۸	۳-۷-۱ مفهوم
۲۰۱	۳-۷-۲ آزمون علّیت گرنجر
۲۰۴	۳-۸ مثال
۲۱۴	۳-۹ ضمیمه
	فصل چهارم: واکنش های ضربه ای و ساخت الگوی خودبازگشت برداری ساختاری
۲۱۷	۴-۱ مقدمه
۲۱۹	۴-۲ الگوها
۲۲۶	۴-۳ تحلیل واکنش های ضربه ای
۲۲۶	۴-۳-۱ افرایندهای VAR ایستا
۲۲۹	۴-۳-۲ تحلیل واکنش ضربه ای VAR و VECM نایستا
۲۳۴	۴-۴ برآورد پارامترهای ساختاری
۲۳۴	۴-۴-۱ الگوهای SVAR
۲۳۹	۴-۴-۲ VECM ساختاری
۲۴۰	۴-۵-۱ استنباط آماری واکنش های ضربه ای
۲۴۰	۴-۵-۱ مبانی نظری برآورد مجانبی
۲۴۱	۴-۵-۲ واکنش های ضربه ای باز نمونه گیری شده

۲۴۳	۴-۵-تحلیل
۲۴۷	۴-۶-تجزیه واریانس خطای پیش بینی
۲۴۸	۴-۷-ارائه چند مثال
۲۴۸	۴-۷-۱-الگوی AB ساده
۲۵۱	۴-۷-۲-الگوی بلانچارد-کوا
۲۵۵	۴-۷-۳-الگوی SVECM برای داده های بازار کار کشور کانادا
۲۶۴	۴-۸-نتیجه گیری
	فصل پنجم: آزمونهای واریانس شرطی
۲۶۷	۵-۱-حقوقی در مورد فرایند تجربی قیمت
۲۶۹	۵-۲-الگوهای تک متغیره GARCH
۲۷۰	۵-۲-۱-ویژگی های مدل های GARCH
۲۷۳	۵-۲-۲-برآورد فرایند های GARCH
۲۷۵	۵-۲-۳-تعمیم ها
۲۸۰	۵-۲-۴-ماتریس اطلاع با ویژگی قطری، مثبت
۲۸۱	۵-۲-۵-آزمون تبیین
۲۸۲	۵-۲-۶-یک نمونه تجربی از نرخ ارز
۲۸۷	۵-۳-الگوهای GARCH چند متغیره
۲۸۸	۵-۳-۱-تبیین های متفاوت الگو
۲۹۲	۵-۳-۲-برآورد الگوهای GARCH چند متغیره
۲۹۴	۵-۳-۳-تعمیم ها
۲۹۵	۵-۳-۴-ادامه توضیحات کاربردی
	فصل ششم: ساخت الگوی رگرسیون انتقال هموار
۲۹۹	۶-۱-مقدمه
۲۹۹	۶-۲-الگو
۳۰۳	۶-۳-الگوسازی ادوار تجاری
۳۰۳	۶-۳-۱-تبیین
۳۰۷	۶-۳-۲-برآورد پارامترها

۳۰۸	۳-۳-۳ ارزیابی
۳۱۵	۴-۶ دو مثال تجربی
۳۱۵	۴-۶-۱ داده های شیمیایی
۳۱۹	۴-۶-۲ تقاضای پول (M1) کشور آلمان
۳۲۳	۵-۶ نکته آخر

فصل هفتم: تبیین الگوی سری زمانی ناپارامتری

۳۲۵	۷-۱ مقدمه
۳۲۷	۷-۲ برآورد خطی موضعی
۳۲۸	۷-۲-۱ برآورد داده ها
۳۳۱	۷-۲-۲ ویژگی های مجازی
۳۳۴	۷-۲-۳ فاصله های اطمینان
۳۳۶	۷-۲-۴ ترسیم تابع برآوردی
۳۳۹	۷-۲-۵ پیش بینی
۳۳۹	۷-۳ انتخاب مقادیر تاخیری و پهنای باند
۳۴۲	۷-۳-۱ برآورد پهنای باند
۳۴۴	۷-۳-۲ گزینش مراتب تاخیری
۳۴۸	۷-۳-۳ مثال
۳۴۹	۷-۴ معیارهای تشخیصی
۳۵۱	۷-۵ ساخت الگو برای نوسان شرطی
۳۵۲	۷-۵-۱ برآورد
۳۵۳	۷-۵-۲ انتخاب پهنای باند
۳۵۴	۷-۵-۳ گزینش مقادیر تاخیری
۳۵۵	۷-۵-۴ خطاهای ARCH
۳۵۷	۷-۶ ساخت الگوی فصلی خطی موضعی
۳۵۸	۷-۶-۱ الگوی خودبازگشت غیرخطی فصلی
۳۵۹	۷-۶-۲ الگوی خودبازگشت غیرخطی با متغیر مجازی فصلی
۳۶۱	۷-۶-۳ الگوی خودبازگشت غیرخطی با متغیر انتقال فصلی

۷-۷ مثال اول: میانگین ساعات کاری هفتگی امریکا

۷-۸ مثال دوم: شاخص XETRADax

فصل هشتم: نرم افزار JMulTi

۸-۱ مقدمه ای بر JMulTi

۸-۱-۱ مفاهیم مربوط به نرم افزار

۸-۱-۲ اجرای JMulTi

۸-۲ اعداد، زمان ها و متغیر ها در JMulTi

۸-۲-۱ اعداد

۸-۲-۲ جدول اعداد

۸-۲-۳ زمان

۸-۲-۴ اسامی متغیر

۸-۳ داده مجموعه داده ها

۸-۳-۱ ورود داده ها

۸-۳-۲ قالب اکسل

۸-۳-۳ قالب اسکی

۸-۳-۴ قالب JMulTi

۸-۴ انتخاب، تبدیل و ایجاد متغیرهای جدید

۸-۴-۱ انتخاب کننده سری های زمانی

۸-۴-۲ محاسبه گر سری های زمانی

۸-۵ سامان دهی متغیرها در JMulTi

۸-۶ نکاتی برای توسعه دهندگان نرم افزار اقتصادسنجی

۸-۶-۱ موارد کلی

۸-۶-۲ قالب JStatCom

۸-۶-۳ ساختار جزء

۸-۷ نتیجه گیری