

بسم الله الرحمن الرحيم

۲۴۹۴۰۵۸

راهنمای RATS

برای

مقدمای بر اقتصادسنجی مالی

مترجمین:

دکتر حمید هوشمندی

دکتر لیلا بخشی سورشجانی

استادیار دانشگاه آزاد اسلامی واحد بهبهان

سرشناسه	کریس بروکز، ۱۹۷۱ م. <i>Chris Brooks</i>
عنوان و پدیدآور	راهنمای RATS برای مقدمه ای بر اقتصادسنجی مالی / نویسنده: کریس بروکز ترجمه: دکتر حمید هوشمندی و دکتر لیلا بخشی سورشجانی
مشخصات نشر	تهران: نور علم.
مشخصات ظاهری	۲۹۹ ص.: نمودار، مصور.
شابک	۹۷۸-۶۰۰-۱۶۹-۲۳۵-۲
وضعیت فهرست نویسی	بر اساس اطلاعات فیپا (فهرست نویسی پیش از انتشار).
یادداشت	عنوان اصلی: <i>RATS Handbook to Accompany Introductory Econometrics for Finance</i>
موضوع	اقتصادسنجی -- برنامه های کامپیوتری
موضوع	امور مالی -- الگوهای اقتصادسنجی
موضوع	اقتصادسنجی مالی - نرم افزار <i>RATS</i>
شناسه اف	کریس بروکز، ۱۹۷۱ م. <i>Chris Brooks</i>
شناسه زود	هوشمندی، حمید: ۱۳۵۰، مترجم.
شناسه اف رده	بخشی سورشجانی، لیلا: ۱۳۵۲، مترجم.
رده بندی کنگره	۱۳۹۶ ز ۴۲ ب / ۱۷۳ HM
رده بندی دیویی	۳۲۲/۰

نشر نور علم: تهران - خ. انتساب خ. ۱ فروز دین - نیش نظری - پ ۹۸ - - تلفن: ۶۶۴۰۵۸۹۴ و ۶۶۴۰۵۸۸۰
noreelm@yahoo.com ۰۹۱۲ ۳۳۴۱ - فروشگاه در تهران: دانشکده اقتصاد دانشگاه تهران

عنوان: راهنمای RATS برای مقدمه ای بر اقتصادسنجی مالی

نویسنده: کریس بروکز

ترجمه: دکتر حمید هوشمندی و دکتر لیلا بخشی سورشجانی

ناشر: نور علم

شمارگان: ۵۰۰ جلد

شابک: ۹۷۸-۶۰۰-۱۶۹-۲۳۵-۲

نوبت چاپ: اول بهار ۱۳۹۶.

چاپ و صحافی: الغدير

قیمت: ۲۰۰۰۰ تومان

فروشگاه در تهران: دانشکده اقتصاد دانشگاه تهران پایگاه اینترنتی: www.nooreelm.com

موبایل کار: در صورت عدم دسترسی به کتابهای این انتشارات، از طریق تماس با شماره زیر
۰۹۱۲۳۳۴۲۲۹ کتابها با پست به تمام نقاط ایران ارسال می شود.

کتاب راهنمای RATS برای مقدمه‌ای بر اقتصادسنجی مالی

این کتاب که با هدف تکمیل ویراست دوم کتاب درسی پر فروش مقدمه‌ای بر اقتصادسنجی مالی نگاشته شده است، مقدمه‌ی جامعی را جهت استفاده از نرم‌افزار تحلیل رگرسیونی سری‌های زمانی (RATS) برای مدل‌سازی در زمینه مالی و غیر آن ارائه می‌کند. کتاب حاضر مجموعه‌ای غنی از مثال‌های کاربردی با کدهای به‌دقت تشریح شده و توضیحات مفصل خروجی‌ها را ارائه نموده، تا بدین ترتیب خوانندگان دانش و اطمینان لازم را جهت استفاده از این نرم‌افزار در تحقیقات و تفسیر نتایج خویش به دست آورند. نسخه وسیعی از رویکردهای مهم مدل‌سازی از جمله موضوعاتی مانند تحلیل سری‌های زمانی، پیش‌بینی، مدل‌های تغییر جهت و روش‌های شبیه‌سازی، پوشش داده شده‌اند. کتاب حاضر به کمک وب سایت همراهی پشتیبانی می‌شود که داده‌های بارگیری‌پذیر و دستورالعمل‌های RATS را به‌طور رایگان ارائه می‌نماید.

کریس بروکز، پروفسور مالی در مرکز انجمن بین‌المللی بازار سرمایه ICMA، دانشگاه ری‌دینگ، انگلستان بوده، و درجه دکتری تخصصی خود را از آن مرکز اخذ کرده است. او بیش از ۶۰ مقاله در مجلات علمی برجسته و حرفه‌ای از جمله

Journal of Business, the Journal of Banking and Finance, the Journal of Empirical Finance, the Review of Economics and Statistics and the Economic Journal

به چاپ رسانده است. او ویراستار دستیاری تعدادی از مجلات از جمله International Journal of Forecasting می‌باشد. او همچنین به‌عنوان مشاور برای بانک‌ها و گروه‌های حرفه‌ای مختلف در حوزه‌های مالی، اقتصادسنجی و املاک فعالیت نموده است.

عکس‌های صفحه‌نمایش

صفحه	عنوان
۵	۱-۱ نمایش هنگام باز شدن RATS
۷	۱-۲ کنار هم قرار دادن پنجره‌های ورودی و خروجی
۱۵	۱-۳ RATS در وضعیت 'Main'
۱۶	۱-۴ RATS در وضعیت 'Local'
۱۷	۱-۵ پنجره Input Format
۱۸	۱-۶ پنجره New Series Date
۲۶	۱-۷ آموزشگر نمودار
۴۰	۱-۲ پنجره کوواریانس‌ها/همبستگی‌های مقطعی
۴۲	۱-۲ آموزشگر رگرسیون‌های تک‌متغیره
۷۵	۱-۴ یافتن فایل SRC
۷۷	۱-۴ اولویت‌های تنظیم در RATS
۱۴۳	۱-۶ آموزشگر VAR
۱۷۹	۱-۷ آموزشگر CATS

عنوان

صفحه

۷-۲ منوهای اضافی قابل دسترس به وسیله ی CATS

۱۸۰

۸-۱ آموزش گر GARCH

۱۹۲

۱۰-۱ پنجره New Series Date

۲۴۸

www.ketab.ir

۱۳

۱۴

۱۵

۱۶

۱۷

۱۸

۱۹

مقدمه

این کتاب راهنمای *RATS*، ویراست دوم *مقدمه‌ای بر اقتصادسنجی مالی* (انتشارات دانشگاه کمبریج، ISBN: 9780521694681) را همراهی می‌کند. ویراست اول *مقدمه‌ای بر اقتصادسنجی مالی* بجای رایج به استفاده از نرم‌افزار *RATS* را به رشته تحریر در آورده است، اما شمول مطالب اضافی در ویراست دوم نیاز به انتقال به یک کتاب راهنمای *RATS* جداگانه داشت تا این اطمینان حاصل شود که کتاب درسی اندازه معقولی دارد. قصد بر آن نیست که کتاب حاضر به عنوان یک کتاب درسی مستقل مطرح شود، و در نتیجه در تمامی تئوری، زمینه و مطالعات موردی مربوط به *مقدمه‌ای بر اقتصادسنجی مالی* در این کتاب تکرار نمی‌شود. در عوض، جهت توضیح چگونگی استفاده از *RATS* برای حل مسائل و دیگر موارد در زمینه مالی تجربی، از مثال‌های زیاد با داده‌های واقعی *مقدمه‌ای بر اقتصادسنجی مالی* استفاده می‌شود. در کتاب حاضر بر تکرار مثال تمرکز شده است و نه بر کارکرد-داشتگی کامل نرم‌افزار. در نتیجه این کتاب راهنما باید برای کسی که قصد یادگیری چگونگی استفاده از *RATS* را دارد مفید باشد و فرض بر این است که خوانندگان هیچ گونه آشنایی قبلی با این نرم‌افزار ندارند. اگرچه تمرکز مثال‌ها، این کتاب بر موضوعات مالی است، اما بیشتر متدولوژی عمومی است و در نتیجه کتاب حاضر می‌تواند به شکلی مفید در سایر حوزه‌های کاربردی از قبیل اقتصاد، بازرگانی یا املاک مورد استفاده قرار گیرد. ویراست اول کتاب درسی اصلی، خروجی حاصل از بسته‌ی *RATS* با فونت کوریر پونت ۱۲ در یک بعبه قرار داده شده است، جهت این‌که خوانندگان قادر به تایپ، یا فعالیت‌هایی باشند که باید دنبال شوند، دستورالعمل‌ها با نوع حروف سیاه نوشته شده است. تمامی مجموعه دستورالعمل‌های بسط داده شده در این کتاب همراه با داده‌ها در وب سایت انتشارات دانشگاه کمبریج در سایت www.cup.cam.ac.uk/brooks در دسترس می‌باشد.

من از تام دوآن و تام مایکوک در استیما برای حمایت و همکاری‌شان با برنامه‌های من، و از دوآن برای توضیحات مفید بسیاری در مورد پیش‌نویس نسخه خطی اولیه سپاسگزارم. به‌طور طبیعی، من مسئولیت هر نوع خطاهای باقی‌مانده را می‌پذیرم.

راجع به مقدمه‌ای بر اقتصادسنجی مالی

اولین کتاب درسی جهت تدریس اقتصادسنجی برای دانشجویان مالی با فروش خوبی مواجه شد، اکنون مقدمه‌ای بر اقتصادسنجی مالی با گنجاندن دو فصل جدید در ویراست دومش کاملاً تجدیدنظر و به‌روز شده است. تدریس درسی اساساً بر شهود و نه بر فرمول پایه‌گذاری شده است، تا بدین ترتیب دانشجویان مهارت‌ها و اطلاعات لازم و در عین حال درکی شهودی از مفاهیم زیربنایی تئوریک را بدست آورند.

این رویکرد، که بر پایه کلاس‌های موفق است؟ من در مرکز انجمن بین‌المللی بازار سرمایه ICMA، یکی از مدارس پیشرو انگلستان، و مدرسه Cass لندن تدریس نموده‌ام، و این اطمینان را می‌دهد که کتاب درسی مستقیماً برای پاسخگویی به نیازهای دانشجویان مالی نگاشته شده است. این کتاب فرض را بر عدم دانش قبلی اقتصادسنجی می‌گذارد و موضوعات مدرن و مهم از قبیل پیش‌بینی سری‌های زمانی، مدل‌های تغییرپذیری، مدل‌های تغییر جهت و روکردهای متغیر وابسته محدود شده و داده‌های تابلویی را پوشش می‌دهد. کتاب حاضر در بر دارنده مثال‌های تفصیلی و مطالعات موردی از ادبیات مالی است. بعلاوه، دستورالعمل‌های نمونه و خروجی از EViews به‌صورت بخشی لاینفک از این کتاب درسی معرفی شده‌اند. همچنین پیشنهادهایی جهت برنامه‌ریزی و اجرای یک پروژه در زمینه مالی تجربی ارائه گردیده است.

راجع به نویسنده

کریس بروکز پروفیسور مالی در مرکز انجمن بین‌المللی بازار سرمایه ICMA، دانشگاه ری‌دینگ، انگلستان بوده، و درجه دکتری تخصصی خود را از آن مرکز اخذ نموده است. او بیش از ۶۰ مقاله در مجلات مهم، برجسته و حرفه‌ای از جمله

Journal of Business, the Journal of Banking and Finance, the Journal of Empirical Finance, the Review of Economics and Statistics and the Economic Journal

به چاپ رسانده است. او و راستار دستیار تعدادی از مجلات از جمله International Journal of Forecasting می‌باشد. این هم‌نویسان به‌عنوان مشاور برای بانک‌های و گروه‌های حرفه‌ای مختلف در حوزه‌های مالی، اقتصادسنجی و املاک فعالیت نموده است.