تحلیل روش‌های پیشرفته

با استفاده از نرم‌افزار Eviews10

جلد سوم

www.ketab.ir

نویسنده‌گان:

دکتر مسعود خداپناه

(دانشیار اقتصاد دانشکده اقتصاد و علوم اجتماعی دانشگاه شهید چمران اهواز)

صلاح ابراهیمی

(دانشجوی دکتری علوم اقتصادی دانشگاه شهید چمران اهواز)

مریم کریمی کندوله

(کارشناس ارشد اقتصاد)

سر شناسه	: خداپناه، مسعود ۱۳۳۹.
عنوان و پدیدآور	: تحلیل روش‌های پیشرفته با استفاده از نرم‌افزار Eviews10 (جلد سوم)/ نویسنده‌گان: دکتر مسعود خداپناه، صلاح ابراهیمی، مریم کریمی کندوله
مشخصات نشر	: تهران، نور علم.
مشخصات ظاهری	: ۱۲۲ ص.
شابک	: ۳-۳۳۷-۱۶۹-۶۰۰-۹۷۸ شابک دوره ۲-۳۳۴-۱۶۹-۶۰۰-۹۷۸
موضوع	: اقتصاد سنجی پیشرفته.
موضوع	: ای ویوز (فایل کامپیوتر)
موضوع	: اقتصادسنجی -- برنامه‌های کامپیوتری.
شناسه افزوده	: خداپناه، مسعود ۱۳۳۹، نویسنده.
شناسه افزوده	: ابراهیمی، صلاح، ۱۳۶۵، نویسنده.
شناسه افزوده	: کریمی کندوله ، مریم ۱۳۶۶،نویسنده.
رده بندی کنگره	: ۱۳۹۸ ۳ت۴خ/ ۱۳۹ HB
رده‌بندی دیویی	: ۳۳۰/۰۵۲

نشر نورعلم: تهران- خ انقلاب- خ منیری جاوید(اردیبهشت) -پ۱۴- تلفن: ۶۶۴۰۵۸۸۰ و ۶۶۴۰۵۸۹۴

noreelm@yahoo.com ۲۳۱ ۲۹ نروشگاه: دانشکده اقتصاد دانشگاه تهران

- عنوان: تحلیل روش‌های پیشرفته با استفاده از نرم‌افزار Eviews10 (جلد سوم)
- نویسنده‌گان: دکتر مسعود خداپناه، صلاح ابراهیمی، مریم کریمی کندوله
- ناشر: نور علم
- شمارگان: ۱۰۰۰ جلد
- شابک: ۳-۳۳۷-۱۶۹-۶۰۰-۹۷۸
- نوبت چاپ: اول ۱۳۹۸
- چاپ و صحافی: الغدیر
- قیمت: ۲۵۰۰۰ تومان

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

www.ketab.ir

فهرست مطالب

فصل شانزدهم: مدل‌های خود رگرسیون برداری VAR ۷
مقدمه ۷
کار با نرم‌افزار ۸
برآورد یک مدل VAR ۸
نتیجه برآورد ۱۱
نکاتی در زمینه محاسبات آماره‌های سیستم: ۱۳
برآورد یک مدل بیزین در ایویوز ۱۴
بخش Prior Type ۱۶
بخش Prior Specification ۱۷
بخش **Prior** Litterman / Minnesota ۱۷
مثال تجربی ۱۸
فصل هفدهم: آرچ و گارچ ۲۳
مقدمه ۲۳
مدل‌های GARCH ۲۴
مدل GARCH (1 , 1) ۲۴
مدل GARCH (p , q) ۲۵
فرضیات توزیعی ۲۶
کار با نرم‌افزار ۲۸
بخش Model ۲۹
مثال GARC(1 , 1) ۳۱
نکته پایانی ۳۴
فصل هجدهم: رگرسیون کوانتایل ۳۵
مقدمه ۳۵
کار با نرم‌افزار ۳۶
بخش Specification ۳۷
بخش Estimation Options ۳۸
بخش Quantile Regression Options ۳۸
بخش Bootstrap Settings ۴۰

www.ketab.ir

بخش Estimation Output ۴۲
منابعی برای مطالعه بیشتر ۴۵
فصل نوزدهم: مدل‌های فضای حالت و فیلتر کالمن ۴۷
مقدمه ۴۷
کار با نرم‌افزار ۴۸
تعیین یک مدل فضای حالت در ایویوز ۴۸
تصریح معادلات حالت ۴۹
مثال‌ها ۵۰
مشاهدات و معادلات سیگنال ۵۱
مثال‌ها ۵۲
کار با نرم‌افزار ۵۳
مشخصات خودکار ۵۵
برآورد مدل فضای حالت ۵۸
نکته مهم ۵۹
منابعی برای مطالعه بیشتر ۶۲
فصل بیستم: رگرسیون سوئیچینگ ۶۳
مقدمه ۶۳
کار با نرم‌افزار ۶۴
بخش Switching Specification ۶۶
بخش Option ۶۶
بخش Switching ۶۷
بخش Coefficient Covariance Options ۶۷
بخش Starting Value and Iteration Options ۶۸
بخش Start Method ۶۹
بخش Randomized Estimates ۶۹
بخش Optimization Options ۷۰
منابعی برای مطالعه بیشتر ۷۱
فصل بیست و یکم: تجزیه و تحلیل معادلات چندگانه ۷۳
مقدمه ۷۳

www.ketab.ir

روش‌های معادلات همزمان ۷۵
حداقل مربعات معمولی (OLS) ۷۶
معادلات رگرسیون وزنی ۷۶
رگرسیون‌های به ظاهر غیرمرتبط (SUR) ۷۶
حداقل مربعات دو مرحله‌ای (2SLS) ۷۷
واریانس ناهمسانی شرطی اتورگرسیو (ARCH) ۷۷
کار با نرم‌افزار ۷۸
بخش Equation ۸۰
ابزارها ۸۲
چند نکته ۸۴
برآورد یک سیستم با نرم‌افزار ویوز ۸۵
تنظیمات GMM ۸۶
بخش ARCH ۸۸
بخش FIML ۸۹
سایر گزینه‌ها ۹۱
مروری بر یک مثال تجربی ۹۴
مثال تجربی گرین (۱۹۹۷) ۹۴
مرحله اول ۹۵
مثال تجربی با System ARCH ۱۰۳
سوال مهم؟ ۱۱۱
منابعی برای مطالعه بیشتر ۱۱۲
فصل بیست و دوم: رگرسیون آستانه ۱۱۵
مقدمه ۱۱۵
کار با نرم‌افزار ۱۱۷
بخش Specification ۱۱۸
بخش Option ۱۲۰
روش های برآورد مقدار آستانه ۱۲۰
منابع مرتبط برای مطالعه بیشتر ۱۲۲

www.ketab.ir