

مجموعه سؤالات چهار جوابی (۲۰۰۰ تست)

اقتصادسنجی

ویژه داوطلبان کنکور کارشناسی ارشد و دکتری

(رشته‌های مجموعه علوم اقتصادی - مهندسی اقتصاد کشاورزی -
مهندسی سیستم‌های اقتصادی و اجتماعی)

نشر نور علم

۱۳۹۲

سرشناسه	ازوجی . علاء الدین ، ۱۳۵۱.
عنوان و پدیدآور	مجموعه سئوالات چهار جوابی (۲۰۰۰ تست) اقتصادسنجی / تالیف: علاء الدین ازوجی.
مشخصات نشر	نور علم.
مشخصات ظاهری	۵۳۰ ص.
شابک	۹۷۸-۶۰۰-۱۶۹-۱۰۲-۷
وضعیت فهرست‌نویسی	بر اساس اطلاعات فیبا (فهرست‌نویسی پیش از انتشار).
یادداشت	کتابنامه ص ۵۲۹-۵۳۰.
یادداشت	ازوجی . علاء الدین ، ۱۳۵۱. مولف.
موضوع	اقتصادسنجی -- آزمون‌ها.
موضوع	اقتصادسنجی - آمار
رده‌بندی کنگره	۱۳۹۲ م۲ الف / ۱۳۹ / HB
رده‌بندی دی‌سی	۳۳۰/۱۵:

نام کتاب : مجموعه سئوالات چهار جوابی اقتصادسنجی (۲۰۰۰ تست)،

ویژه داوطلبان کنکور کارشناسی ارشد و دکتری

تألیف : علاء الدین ازوجی

ناشر : نشر نور علم

صفحه‌آرایی : هانی توانایان فرد

چاپ و صحافی : الغدیر

نوبت چاپ : اول ۱۳۹۲

شمارگان : ۱۰۰۰ جلد

قیمت : ۱۸۵۰۰۰ ریال

فروشگاه در تهران: خیابان انقلاب- روبروی دبیرخانه دانشگاه تهران - بین خیابان فروردین و اردیبهشت - کتابسرای اندیشه- نشر نور علم
پایگاه اینترنتی: www.noo-reelm.com

موبایل کار: در صورت عدم دسترسی به کتاب‌های این انتشارات، از طریق تماس با

شماره ۰۹۱۲۳۳۳۴۲۲۹ کتاب‌ها با پست به تمام نقاط ایران ارسال می‌شود.

پیش گفتار	ز
فصل اول: کلیات اقتصاد سنجی و ماهیت تحلیل رگرسیون	۱
پاسخنامه تشریحی سئوالات فصل اول	۱۵
فصل دوم: تحلیل و مساله تخمین مدل رگرسیون دو متغیره	۲۱
پاسخنامه تشریحی سئوالات فصل دوم	۶۷
فصل سوم: ویژگی های تخمین زنده مدل رگرسیون خطی	۸۵
پاسخنامه تشریحی سئوالات فصل سوم	۹۷
فصل چهارم: تخمین فاصله ای و آزمون فرضیه رگرسیون دو متغیره	۱۰۳
پاسخنامه تشریحی سئوالات فصل چهارم	۱۲۱
فصل پنجم: گسترش مدل رگرسیون خطی دو متغیره	۱۲۹
پاسخنامه تشریحی سئوالات فصل پنجم	۱۴۳
فصل ششم: تحلیل رگرسیونی چند متغیره و استنتاج آماری آن	۱۴۹
پاسخنامه تشریحی سئوالات فصل ششم	۱۶۹
فصل هفتم: روش ماتریسی مدل رگرسیون خطی	۱۷۷
پاسخنامه تشریحی سئوالات فصل هفتم	۱۸۵
فصل هشتم: روش تخمین حداکثر راستنمایی (LM)	۱۸۹
پاسخنامه تشریحی سئوالات فصل هشتم	۱۹۹
فصل نهم: هم خطی	۲۰۳
پاسخنامه تشریحی سئوالات فصل نهم	۲۱۷
فصل دهم: ناهمسانی واریانس	۲۲۵
پاسخنامه تشریحی سئوالات فصل دهم	۲۴۷
فصل یازدهم: خودهمبستگی	۲۵۹
پاسخنامه تشریحی سئوالات فصل یازدهم	۲۸۳
فصل دوازدهم: تصریح مدل و مدل سازی اقتصاد سنجی	۲۹۵

۳۱۷.....	پاسخنامه تشریحی سؤالات فصل دوازدهم
۳۲۷.....	فصل سیزدهم: رگرسیون بر روی متغیرهای موهومی (مجازی)
۳۴۵.....	پاسخنامه تشریحی سؤالات فصل سیزدهم
۳۵۳.....	فصل چهاردهم: متغیر وابسته موهومی
۳۶۵.....	پاسخنامه تشریحی سؤالات فصل چهاردهم
۳۷۱.....	فصل پانزدهم: مدل‌های خودرگرسیون و با وقفه توزیعی
۳۸۵.....	پاسخنامه تشریحی سؤالات فصل پانزدهم
۳۹۳.....	فصل شانزدهم: سیستم معادلات همزمان
۴۱۳.....	پاسخنامه تشریحی سؤالات فصل شانزدهم
۴۲۳.....	فصل هفدهم: سری زمانی، ریشه‌های واحد و هم‌انباشتگی
۴۵۵.....	پاسخنامه تشریحی سؤالات فصل هفدهم
۴۷۱.....	فصل هیجدهم: پیش‌بینی سری زمانی با مدل‌های VAR و ARMA
۴۸۹.....	پاسخنامه تشریحی سؤالات فصل هیجدهم
۴۹۷.....	فصل نوزدهم: مدل‌های داده‌های تلفیقی (پانل دیتا)
۵۰۷.....	پاسخنامه تشریحی سؤالات فصل نوزدهم
۵۱۱.....	فصل بیستم: واریانس غیر شرطی و الگوهای رگرسیون غیر خطی
۵۲۳.....	پاسخنامه تشریحی سؤالات فصل بیستم
۵۲۹.....	فهرست منابع و مآخذ

پیش گفتار

اقتصادسنجی بخشی از علم اقتصاد است که با بکارگیری از مفاهیم علم آمار و ریاضی، متغیرهای اقتصادی را به صورت کمی مورد تجزیه و تحلیل قرار می‌دهد. مروری بر سرفصل‌های درس اقتصادسنجی در دانشگاه‌های معتبر دنیا نشان می‌دهد که در هر دهه روند رو به پیشرفتی در مباحث این بخش از اقتصاد را شاهد هستیم. استفاده از اقتصادسنجی در مباحث تجربی در موضوعات اقتصادی کشورها به ویژه مطالعات خرد و کلان، موجب اطمینان بخشی بیشتری نسبت به استفاده از ابزار اقتصادسنجی در تحلیل‌ها شده است. در کشور ما به دلایل مختلف این درس نسبت به پیشرفت آن در محافل دانشگاه‌های معتبر دنیا، کمتر مورد توجه بوده است و به نظر می‌رسد بخشی از آن ناشی از نتایج حاصله از مطالعات تجربی در کشور بوده که بر اساس آمار و اطلاعات ناقص و یا با درجه خطای بالا همراه بوده و موجب گردید که استفاده از اقتصادسنجی در تحلیل‌ها (برخلاف کشورهای توسعه یافته) کمتر مورد توجه قرار گیرد.

امید است که در آینده استفاده از ابزار اقتصادسنجی در محافل دانشگاهی و موسسات دولتی و خصوصی بیش از پیش مورد توجه قرار گیرد. حال با توجه به این که درس اقتصادسنجی در سرفصل‌های ورودی دوره دکتری رشته‌های علوم اقتصادی قرار گرفته، خود می‌تواند گامی به جلو برای تاکید بیشتر بر آن و ارتقای سطح تگرس دانشجویان مقاطع کارشناسی ارشد و دکتری و همچنین توسعه اقتصادسنجی در دانشکده‌های اقتصاد دانشگاه‌های کشور باشد و انتظار بر این است که با پیشرفت اقتصادسنجی و استفاده آن در مباحث سیاست گذاری نقش مثبت در تصمیم سازی‌ها عینی تر گردد.

مجموعه پیش رو، برگرفته از سرفصل‌های دوره کارشناسی ارشد و گاه دوره دکتری درس اقتصادسنجی (مبانی، کاربردی و پیشرفته) است. مولف سعی داشته است از عمده کتاب‌های تالیف شده و ترجمه شده اقتصادسنجی داخل کشور برای تهیه و تنظیم سؤالات بهره بگیرد. قبل از ورود به فصل‌ها ذکر چند نکته ضروری است:

اول این که تهیه سؤالات هر فصل به نحوی تنظیم شده است که تقریباً سؤالات آسان تر در اوایل هر فصل و سؤالات دشوارتر از اواسط فصل به بعد تا انتهای هر فصل قرار گیرد.

دوم این که مروری بر سؤالات طبقه بندی شده سال‌های اخیر دوره دکتری درس اقتصادسنجی نشان می‌دهد که عمده سؤالات به صورت مفهومی طرح شده اند و کمتر بر محاسبات کمی متمرکز دارد. در این کتاب هم تاکید بیشتر بر تنظیم سؤالات مفهومی برای هر فصل می‌باشد که ذهن دانشجویان و داوطلبان را به این سمت سوق دهد تا بتوانند بیشتر بر مسائل اساسی اقتصادسنجی مسلط شوند.

سوم این که معمولاً سرفصل‌های کتاب اقتصادسنجی دارای چارچوب مشخص نبوده ولی در این کتاب سعی شده است برآیندی از سرفصل‌های کتب مطرح، تهیه و تنظیم شود.

چهارم این که در انتهای هر فصل برخی از سؤالات طبقه بندی شده دوره‌های ورودی کارشناسی ارشد و دکتری سراسری و آزاد اضافه شده است که به دلیل محدودیت آن انتظار بر این است که در چاپ‌های بعدی تکمیل تر شود.

پنجم این که قبل از پاسخ دادن به تست‌های هر فصل تاکید می‌شود کتاب‌های اقتصادسنجی که در بر گیرنده فصل مربوطه باشد حتما مورد مطالعه قرار گیرد.

ششم این که هر فصل به تناسب مباحث و محتوی آن، سؤالات این کتاب تنظیم شده است که ترکیب تعداد سؤالات فصول با هم متفاوت خواهد بود که در جدول ذیل آمده است.

در نهایت این که پاسخ‌های تشریحی کوتاه به نحوی ارائه شده است که نکات کلیدی مباحث را به طور مختصر بیان نماید.

خاطر نشان می‌سازد که این اثر مانند سایر تالیفات خالی از خطا و اشتباه نبوده و امید است دانشجویان و داوطلبان گرامی و حتی اساتید محترم خطای چاپی و محتوایی آن را به آدرس الکترونیکی ALAEZO@GMAIL.COM گوشزد نمایند تا در ویرایش بعدی اصلاح گردد.

لازم می‌دانم از اساتید و دوستان گرامی خود آقایان دکتر غلامرضا کشاورز حداد، دکتر قهرمان عبدلی، دکتر نادر مهرگان، دکتر قدرت الله امام وردی، مهدی پازوکی، صادق داداشی، محمد ندیری و ابراهیم قدیری و همچنین همکاران دفتر برنامه ریزی اقتصاد کلان معاونت برنامه ریزی و نظارت راهبردی ریاست جمهوری که همواره مشوق بنده در تدوین و تهیه این کتاب بودند صمیمانه تشکر نمایم.

همچنین از کمک و همراهی همسرم سرکار خانم سمیه ازوجی که ماهرانه و بادقت مطالب را مطالعه نموده و ویرایش کرده است، تقدیر و تشکر می‌نمایم.

در انتها لازم می‌دانم از مدیریت انتشارات نور علم و چاپخانه نقش بابت زحماتی که در طی چاپ این کتاب متحمل شده‌اند تشکر و قدردانی نمایم.

شماره فصل	عنوان	تعداد سؤال فصل	سهم هر فصل از کل
فصل اول	کلیات اقتصاد سنجی و ماهیت تحلیل رگرسیون	۷۸	۳,۹
فصل دوم	تحلیل و مساله تخمین مدل رگرسیون دو متغیره	۲۹۲	۱۴,۶
فصل سوم	ویژگی‌های تخمین زنده مدل رگرسیون خطی	۶۹	۳,۵
فصل چهارم	تخمین فاصله‌ای و آزمون فرضیه رگرسیون دو متغیره	۱۰۵	۵,۳
فصل پنجم	گسترش مدل رگرسیون خطی دو متغیره	۷۵	۳,۸
فصل ششم	تحلیل رگرسیونی چند متغیره و استنتاج آماری آن	۱۰۷	۵,۴
فصل هفتم	روش ماتریسی مدل رگرسیون خطی	۳۳	۱,۷
فصل هشتم	روش تخمین حداکثر راستنمایی (LM)	۴۸	۲,۴
فصل نهم	هم خطی	۷۵	۳,۸
فصل دهم	ناهمسانی واریانس	۱۱۵	۵,۸
فصل یازدهم	خودهمبستگی	۱۳۷	۶,۹
فصل دوازدهم	تصریح مدل و مدل سازی اقتصاد سنجی	۱۲۱	۶,۱
فصل سیزدهم	رگرسیون بر روی متغیرهای موهومی (مجازی)	۹۹	۵,۰

شماره فصل	عنوان	تعداد سؤال فصل	سهم هر فصل از کل
فصل چهاردهم	متغیر وابسته موهومی	۶۵	۳.۳
فصل پانزدهم	مدل‌های خودرگرسیون و با وقفه توزیعی	۷۴	۳.۷
فصل شانزدهم	سیستم معادلات همزمان	۱۱۱	۵.۶
فصل هفدهم	سری زمانی، ریشه‌های واحد و هم‌انباشتگی	۱۹۱	۹.۶
فصل هجدهم	پیش‌بینی سری زمانی با مدل‌های VAR و ARIMA	۱۰۴	۵.۲
فصل نوزدهم	مدل‌های داده‌های تلفیقی (پانل دیتا)	۴۴	۲.۲
فصل بیستم	واریانس غیر شرطی و الگوهای رگرسیون غیر خطی	۵۷	۲.۹
...	کل فصول	۲۰۰۰	۱۰۰.۰

علاءالدین ازوجی

آبان ماه ۱۳۹۲

www.ketab.ir