



اقتصادسنجی

(قابل استفاده برای دانشجویان ارشد)

نویسنده: فرزانه میرزایی

انتشارات یادعارف

سرشناسه	: میرزایی، فرزانه، ۱۳۶۱ -
عنوان و نام پدیدآور	: اقتصادسنجی (قابل استفاده برای دانشجویان ارشد) / نویسنده فرزانه میرزایی.
مشخصات نشر	: تهران: یاد عارف، ۱۳۹۴.
مشخصات ظاهری	: ۴۲۰ ص: جدول.
شابک	: ۲۲۰۰۰۰ ریال: 978-600-7284-53-7
وضعیت فهرست نویسی	: فیبا
موضوع	: دانشگاه‌ها و مدارس عالی -- ایران -- آزمون‌ها
موضوع	: اقتصادسنجی -- آزمون‌ها و تمرین‌ها (عالی)
موضوع	: اقتصادسنجی -- مسائل، تمرین‌ها و غیره (عالی)
رده بندی کنگره	: ۲۳۵۳LB
رده بندی دیویی	: ۳۷۸/۱۶۶۴
شماره کتابشناسی ملی	: ۳۸۹۸۹۰۷

اقتصادسنجی

نویسنده: فرزانه میرزایی

ناشر: یاد عارف

صفحه آرا و طراح: لیلا حائری مهریزی

نوبت و سال چاپ: اول / ۱۳۹۴

شابک: ۷-۵۳-۷۲۸۴-۶۰۰-۹۷۸

قیمت: ۲۲۰۰۰۰ ریال

تیراژ: ۱۰۰۰ جلد

فهرست مطالب

۹	سوالات تالیفی
۱۰	فصل اول
۱۰	هم خطی
۱۷	فصل دوم
۱۷	ناهمسانی واریانس
۲۶	فصل سوم
۲۶	خود همبستگی
۳۷	فصل چهارم
۳۷	متدولوژی اقتصادسنجی سنتی
۴۴	فصل پنجم
۴۴	متدولوژی اقتصادسنجی آلترناتیو
۴۹	فصل ششم
۴۹	رگرسیون بر روی متغیرهای موهومی
۵۵	فصل هفتم
۵۵	رگرسیون بر روی متغیر وابسته موهومی
۶۶	فصل هشتم
۶۶	مدل خود رگرسیونی و با وقفه توزیعی
۸۲	فصل نهم
۸۲	مدل‌های معادلات همزمان
۸۶	فصل دهم
۸۶	مسأله تشخیص
۹۶	فصل یازدهم
۹۶	روش‌های معادلات همزمان
۱۰۵	فصل دوازدهم
۱۰۵	اقتصادسنجی سری‌های زمانی I
۱۰۵	(ایستایی، ریشه‌های واحد و هم‌انباشتگی)
۱۱۷	فصل سیزدهم
۱۱۷	پیش‌بینی با استفاده از مدل‌های var و ARIMA

۱۲۷	پاسخنامه سوالات تالیفی
۱۲۸	پاسخنامه فصل اول: هم خطی
۱۳۲	پاسخنامه فصل دوم: ناهمسانی واریانس
۱۳۷	پاسخنامه فصل سوم: خود همبستگی
۱۴۷	پاسخنامه فصل چهارم: متدولوژی اقتصادسنجی سنتی
۱۵۳	پاسخنامه فصل پنجم: متدولوژی اقتصادسنجی آلترناتیو
۱۵۹	پاسخنامه فصل ششم: رگرسیون بر روی متغیرهای موهومی
۱۶۴	پاسخنامه فصل هفتم: رگرسیون بر روی متغیر وابسته موهومی
۱۷۰	پاسخنامه فصل هشتم: مدل خود رگرسیونی و با وقفه توزیعی
۱۸۳	پاسخنامه فصل نهم: مدل‌های معادلات همزمان
۱۸۵	پاسخنامه فصل دهم: مسأله تشخیص
۱۹۰	پاسخنامه فصل یازدهم: روش‌های معادلات همزمان
۱۹۶	پاسخنامه فصل دوازدهم: اقتصادسنجی سری‌های زمانی: ایستایی، ریشه‌های واحد و هم‌انبستگی
۲۰۲	پاسخنامه فصل سیزدهم: پیش‌بینی با استفاده از مدل‌های VAR و ARIMA
۲۰۷	سوالات ترمی پیام نور
۲۰۸	فصل اول
۲۰۸	هم خطی
۲۱۷	فصل دوم
۲۱۷	ناهمسانی واریانس
۲۲۸	فصل سوم
۲۲۸	خود همبستگی
۲۳۸	فصل چهارم
۲۳۸	مدلسازی اقتصادسنجی یک، خطا در اندازه‌گیری
۲۴۷	فصل پنجم
۲۴۷	مدلسازی اقتصادسنجی دو، رهیافت
۲۵۳	فصل ششم
۲۵۳	رگرسیون بر روی متغیرهای موهومی
۲۶۰	فصل هفتم
۲۶۰	رگرسیون بر روی متغیر وابسته موهومی
۲۶۷	فصل هشتم
۲۶۷	مدلهای خود رگرسیونی و با وقفه توزیعی
۲۷۶	فصل نهم
۲۷۶	مدلهای معادلات همزمان
۲۸۰	فصل دهم
۲۸۰	مسئله تشخیص
۲۸۹	فصل یازدهم

۲۸۹	 روشهای معادلات همزمان
۲۹۷	 فصل دوازدهم
۲۹۷	 اقتصاد سنجیهای سری زمانی یک
۳۱۰	 فصل سیزدهم
۳۱۰	 اقتصاد سنجیهای سری زمانی دو
۳۳۹	 پاسخنامه سوالات ترمی پیام نور
۳۴۰	 پاسخنامه فصل اول: هم خطی
۳۴۶	 پاسخنامه فصل دوم: ناهمسانی واریانس
۳۵۲	 پاسخنامه فصل سوم: خود همبستگی
۳۶۰	 پاسخنامه فصل چهارم: مدلسازی اقتصاد سنجی یک، خطا در اندازه گیری
۳۶۵	 پاسخنامه فصل پنجم: مدلسازی اقتصاد سنجی دو، رهیافت
۳۶۹	 پاسخنامه فصل ششم: رگرسیون بر روی متغیرهای موهومی
۳۷۴	 پاسخنامه فصل هفتم: رگرسیون بر روی متغیر وابسته موهومی
۳۷۸	 پاسخنامه فصل هشتم: مدل های خود رگرسیونی و با وقفه توزیعی
۳۸۵	 پاسخنامه فصل نهم: مدل های معادلات همزمان
۳۸۷	 پاسخنامه فصل دهم: مسئله تشخیص
۳۹۲	 پاسخنامه فصل یازدهم: روش های معادلات همزمان
۳۹۸	 پاسخنامه فصل دوازدهم: اقتصاد سنجی های سری زمانی یک
۴۰۵	 پاسخنامه فصل سیزدهم: اقتصاد سنجی های سری زمانی دو
۴۰۹	 پاسخنامه فصل چهاردهم:

مقدمه:

کتاب حاضر از دروس اقتصادسنجی دامودار گجراتی ترجمه دکتر حمید ابریشمی و اقتصادسنجی ریشه واحد و همجمعی نوفرستی و سوالات تالیفی، همچنین سوالات ترمی پیام‌نور همراه با پاسخ کاملاً تشریحی می‌باشد. و جهت استفاده دانشجویان تحصیلات تکمیلی در مقطع ارشد تدوین گردیده است. امید است که توانسته باشم در این راه گام موثری جهت پیشرفت دانشجویان محترم برداشته باشم. هرچند که هیچ اثری عاری از ایراد و اشکال نمی‌باشد. اینجانب از خوانندگان عزیز تقاضا دارم نظرات و پیشنهادات خود را به آدرس ذیل ارسال نمایند.

شایسته است از سرکار خانم حائری که واقعا در آماده‌سازی و چاپ این اثر مرا یاری نموده‌اند، تشکر و قدردانی فراوان نمایم.

با تشکر

فرزانه میرزایی

Farzaneh.mirzaee23@yahoo.com