

درآمدی بر اقتصاد سنجی

Panel و Panel-Var

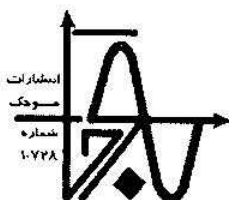
تالیف :

دکتر معصومه حیدری هراتمه

عضو هیات علمی دانشگاه آزاد اسلامی

دکتر شمس اله شیرین بخشی ماسوله

عضو هیات علمی دانشگاه آزاد اسلامی



انشارات موجک



مجله نشریات
مجله نشریات

سرشناسه	: حیدری هراتمه، مصطفی، ۱۳۵۱.
عنوان و نام پدیدآور	: درآمدی بر اقتصاد سنجی Panel و Panel-Var / تألیف دکتر مصطفی حیدری هراتمه، دکتر شمس اله شیرین بخش ماسوله.
مشخصات نشر	: تهران: انتشارات موجک، ۱۳۹۵.
مشخصات ظاهری	: ۹۲ ص: و وزیر.
شابک	: ۸-۰۵-۸۶۳۴-۶۰۰-۹۷۸-۲۰۰۰۰۰ ریال.
وضعیت فهرست نویسی	: فیا
یادداشت	: کتابنامه.
موضوع	: اقتصادسنجی
موضوع	: Econometrics
موضوع	: پیوسته پانلی -- الگوهای اقتصادسنجی
موضوع	: Panel analysis -- Econometric models
موضوع	: شیرین بخش، شمس اله
رده بندی کنگره	: ۱۳۵۰۴ ح ۱۳۹ HB
رده بندی دیویی	: ۱۵۱۹۵
شماره کتابشناسی ملی	: ۴۴۳۷۷۴

انتشارات موجک

تلگرام: ۹۰۱۷۶۷۲۵۰۲ telegram.me/mojak1

تلفن مرکز بخش: ۹۰۱۶۷۲۵۰۲ - ۲۱۶۶۱۲۷۵۹۳

Email: mojakpublication@yahoo.com

Web: www.mojak.ir



عنوان: درآمدی بر اقتصاد سنجی Panel و Panel-Var

تألیف: دکتر مصطفی حیدری هراتمه، دکتر شمس اله شیرین بخش ماسوله

طراح جلد: سیده زهرا روشنایی

مشخصات ظاهری: ۹۲ صفحه، قطع وزیری

چاپ اول: بهار ۱۳۹۶

تیراژ: ۱۰۰۰ جلد - قیمت: ۲۰۰۰۰۰ ریال

شابک: ۸-۰۵-۸۶۳۴-۶۰۰-۹۷۸

حقوق چاپ و نشر برای ناشر محفوظ است.

فهرست مطالب

عنوان

صفحه

فصل اول: مدل پانل (PANEL)	۱
۱-۱ مقدمه	۱
۲-۱ مفهوم مدل پانل (PANEL DATA)	۱
۳-۱ الگوی رگرسیون PANEL DATA	۲
۴-۱ مزایای PANEL DATA	۲
۵-۱ نحوه قرار گرفتن داده‌ها در PANEL DATA	۴
۶-۱ انتخاب میان داده‌های ادغام شده و داده‌های پنل	۵
۷-۱ تخمین مدل‌های رگرسیونی PANEL DATA	۵
فصل دوم: مدل پولینگ (POOLING)	۷
۱-۲ مدل کلی POOLING DATA	۷
۲-۲ روش‌های تخمین مدل (POOLING DATA) به روش اقتصادسنجی	۸
۳-۲ اثرات ثابت (FEM)	۱۰
۴-۲ اثرات تصادفی (ECM)	۱۱
۵-۲ انتخاب از بین FEM و ECM	۱۱
۶-۲ آزمون معنی دار بودن گروه	۱۲
۷-۲ آزمون هاسمن	۱۲
فصل سوم: مدل پانل ور (PANEL VAR)	۱۵
۱-۳ الگوی خودرگرسیون برداری پنل (PANEL - VAR)	۱۵

۱۷.....	۲-۳ خودرگرسیون برداری در داده‌های پنل
۲۲.....	۳-۳ پایداری و مانایی
۲۶.....	۴-۳ شناسایی
۲۹.....	۵-۳ توابع واکنش آنی
۳۲.....	۶-۳ تجزیه واریانس
۳۴.....	۷-۳ تعیین طول وقفه بهینه در مدل‌های VAR
۳۴.....	۱-۷-۳ آزمون نسبت لایکلی هود
۳۵.....	۲-۷-۳ علیت گرنجر
۳۹.....	۸-۳ PANEL-VAR ساختاری
۴۵.....	۹-۳ واکنش آنی تجمیع یافته
۴۷.....	۱۰-۳ آزمون قطری بودن
۴۸.....	۱۱-۳ ویژگی‌های متمایز (PANEL-VAR) نسبت به (PANEL-DATA)
۵۴.....	۱۲-۳ معرفی روش آزمون MWD
۵۵.....	۱۳-۳ ترکیب داده‌های مقطعی و سری زمانی
۵۹.....	۱۴-۳ آزمون ناهمسانی واریانس
۵۹.....	۱۵-۳ آزمون علیت در برآورد داده‌های پنل
۶۰.....	۱۶-۳ آزمون ریشه واحد در برآورد داده‌های پنل

فصل چهارم: انجام الگوی پنل در ایویوز

۶۱.....	۱-۴ کار برگ فابل کاری
۶۱.....	۲-۴ کار برگ باز کردن معادله جهت تخمین
۶۲.....	۳-۴ کار برگ تصریح تخمین معادله
۶۲.....	۴-۴ کار برگ انتخاب گزینه‌های پنل (FIXED OR RANDOM)
۶۳.....	۵-۴ کار برگ تخمین رگرسیون پنل
۶۳.....	۶-۴ کار برگ آزمون چاو (F لیمر)

- ۶۴..... ۷-۴ کار برگ خروجی آزمون چاو (F لیمر)
- ۶۴..... ۸-۴ کار برگ انتخاب گزینه اثرات تصادفی
- ۶۵..... ۹-۴ کار برگ خروجی رگرسیون پل با اثرات تصادفی
- ۶۵..... ۱۰-۴ کار برگ آزمون هاسمن
- ۶۶..... ۱۱-۴ کار برگ خروجی آزمون هاسمن
- ۶۶..... ۱۲-۴ کار برگ تعیین اثرات ثابت یا تصادفی
- ۶۷..... ۱۳-۴ کار برگ تعیین اثرات ثابت مقاطع
- ۶۷..... ۱۴-۴ کار برگ خروجی اثرات ثابت مقاطع
- ۶۸..... ۱۵-۴ کار برگ تعیین اثرات دوره زمانی
- ۶۸..... ۱۶-۴ کار برگ اثرات تصادفی دوره زمانی
- ۶۹..... ۱۷-۴ کار برگ آزمون ایستایی پل (ریشه واحد)
- ۶۹..... ۱۸-۴ کار برگ گزینه‌های آزمون ایستایی پل (ریشه واحد)
- ۷۰..... ۱۹-۴ کار برگ گزینه‌های نوع آزمون ایستایی پل (ریشه واحد)
- ۷۰..... ۲۰-۴ کار برگ خروجی آزمون ایستایی پل (ریشه واحد)
- ۷۱..... ۲۱-۴ کار برگ آزمون‌های آمارهای توصیفی
- ۷۱..... ۲۲-۴ کار برگ آمارهای توصیفی
- ۷۲..... ۲۳-۴ کار برگ خروجی آزمون‌های آمارهای توصیفی
- ۷۲..... ۲۴-۴ کار برگ آزمون همگرایی پل
- ۷۳..... ۲۵-۴ کار برگ نوع آزمون‌های همگرایی پل
- ۷۳..... ۲۶-۴ کار برگ سه نوع آزمون‌های همگرایی پل (پدرونی، کایو، فیشر)
- ۷۴..... ۲۷-۴ کار برگ خروجی آزمون همگرایی پل پدرونی
- ۷۴..... ۲۸-۴ کار برگ خروجی آزمون همگرایی پل KAO
- ۷۵..... ۲۹-۴ کار برگ معادله VAR در پل
- ۷۵..... ۳۰-۴ کار برگ تصریح معادله VAR در پل
- ۷۶..... ۳۱-۴ کار برگ خروجی الگوی VAR در پل

- ۳۲-۴ کار برگ تعیین طول وقفه الگوی VAR در پنل ۷۶
- ۳۳-۴ کار برگ خروجی تعیین طول وقفه الگوی VAR در پنل ۷۷
- ۳۴-۴ کار برگ واکنش آنی الگوی VAR در پنل ۷۷
- ۳۵-۴ کار برگ تعیین نوع واکنش آنی الگوی VAR در پنل ۷۸
- ۳۶-۴ کار برگ خروجی واکنش آنی الگوی VAR در پنل به صورت جدول ۷۸
- ۳۷-۴ کار برگ خروجی واکنش آنی الگوی VAR در پنل به صورت گراف ۷۹
- ۳۸-۴ کار برگ تجزیه واریانس الگوی VAR در پنل ۷۹
- ۳۹-۴ کار برگ تعیین نوع تجزیه واریانس الگوی VAR در پنل ۸۰
- ۴۰-۴ کار برگ تجزیه واریانس الگوی VAR در پنل به صورت جدول ۸۰
- ۴۱-۴ کار برگ تجزیه واریانس الگوی VAR در پنل به صورت گراف ۸۱
- ۴۲-۴ کار برگ آزمون همگرایی یوهانسن - جوسیلیوس ۸۱
- ۴۳-۴ کار برگ تصریح آزمون همگرایی یوهانسن - جوسیلیوس ۸۲
- ۴۴-۴ کار برگ خروجی آزمون همگرایی یوهانسن - جوسیلیوس ۸۲
- ۴۵-۴ کار برگ آزمون‌های مرتبط با پسماند (فروض کلاسیک) ۸۳
- ۴۶-۴ کار برگ آزمون خود همبستگی جمله خطا ۸۳
- ۴۷-۴ کار برگ خروجی آزمون خود همبستگی جمله خطا ۸۴
- ۴۸-۴ کار برگ خروجی آزمون ناهمسانی جمله خطا ۸۵
- ۴۹-۴ کار برگ آزمون نرمالیتی جمله خطا ۸۵
- ۵۰-۴ کار برگ آزمون نرمالیتی چند متغیره جمله خطا ۸۶
- ۵۱-۴ کار برگ خروجی آزمون نرمالیتی جمله خطا ۸۶
- ۵۲-۴ کار برگ تصریح الگوی VAR ۸۷
- ۵۳-۴ کار برگ خروجی تصریح الگوی VECM ۸۷
- ۵۴-۴ کار برگ تصریح الگوی VECM ۸۸
- ۵۵-۴ کار برگ خروجی تصریح الگوی VECM ۸۸
- ۵۶-۴ کار برگ تصریح الگوی BAYESIAN VAR ۸۹

- ۵۷-۴ کار برگ خروجی تصریح الگوی BAYESIAN VAR ۸۹
- ۵۸-۴ کار برگ تصریح PRIOR الگوی VAR ۹۰
- ۵۹-۴ کار برگ گزینه‌های تصریح PRIOR الگوی VAR ۹۰
- ۶۰-۴ کار برگ ایجاد سری جدید ۹۱
- ۶۱-۴ کار برگ گزینه‌های PROC ۹۱
- ۶۲-۴ کار برگ گزینه‌های آبیجت ۹۲

www.ketab.ir