

۱۵۴۷۹۵



اقتصادسنجی

(ف. ا. استفاده برای دانشجویان ارشد)

نویسنده: فرزانه میررای

انتشارات تالیف

سرشناسه	: میرزایی، فرزانه، ۱۳۶۱ -
عنوان و نام پدیدآور	: اقتصادسنجی (قابل استفاده برای دانشجویان ارشد)/ نویسنده فرزانه میرزایی
مشخصات نشر	: تهران: تألیف-۱۳۹۶
مشخصات ظاهری	: ۴۲۱ ص: جدول
شابک	: ۹۷۸-۶۰۰-۹۸۴۶۶-۹-۶
وضعیت فهرست نویسی	: فیپا
موضوع	: دانشگاه‌ها و مدارس عالی - ایران - آزمون‌ها
موضوع	: اقتصاد سنجی -- آزمون‌ها و تمرین‌ها (عالی)
موضوع	: اقتصادسنجی - مسائل، تمرین‌ها و غیره (عالی)
رده بندی کنگره	: ۲۳۵۳LB
رده بندی دیویی	: ۷۰/۱۶۶
شماره کتابشناسی ملی	: ۴۹۳۰۱۱



اقتصادسنجی

نویسنده: فرزانه میرزایی

ناشر: تألیف

صفحه آرا و طراح: لیلا حائری مهریزی

نوبت و سال چاپ: اول / ۱۳۹۶

تیراژ: ۵۰۰ جلد

شابک: ۹۷۸-۶۰۰-۹۸۴۶۶-۹-۶

قیمت: ۲۲۰۰۰۰ ریال

تهران - میدان انقلاب - ضلع شمال شرق میدان - ساختمان ۱۱۳۵ ط ۴

تلفن: ۶۶۴۷۵۳۸۰ - ۶۶۴۱۵۳۶۴ - ۹۱۲۷۹۴۲۷۲۵

حق چاپ برای ناشر محفوظ است.

فهرست مطالب

۹	سوالات تالیفی
۱۰	فصل اول
۱۰	هم خطی
۱۷	فصل دوم
۱۷	ناهمبستگی ریانس
۲۶	فصل سوم
۲۶	خود همبستگی
۳۷	فصل چهارم
۳۷	متدولوژی اقتصادسنجی سنجی
۴۴	فصل پنجم
۴۴	متدولوژی اقتصادسنجی التزانی
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	مدل های معادلات همزمان
۸۶	فصل دهم
۸۶	مسأله تشخیص
۹۶	فصل یازدهم
۹۶	روش های معادلات همزمان
۱۰۵	فصل دوازدهم
۱۰۵	اقتصادسنجی سری های زمانی I
۱۰۵	(ایستایی، ریشه های واحد و هم انباشتگی)
۱۱۷	فصل سیزدهم
۱۱۷	پیش بینی با استفاده از مدل های 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: مدل های معادلات همزمان
۱۸۵	پاسخنامه فصل دهم: مسأله تشخیص
۱۹۰	پاسخنامه فصل یازدهم: روش های معادلات همزمان
۱۹۶	پاسخنامه فصل دوازدهم: اقتصادسنجی سری های زمانی آ ایستایی، ریشه های واحد و همبستگی
۲۰۲	پاسخنامه فصل سیزدهم: پیش بینی با استفاده از مدل های VAR و ARIMA
۲۰۷	سوالات ترمی پیام زر
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 اندازه گیری
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	مدل های خود رگرسیونی و با وقفه توزیعی
۲۷۶	فصل نهم
۲۷۶	مدل های 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: مدل های محدود
۳۹۲	پاسخنامه فصل یازدهم: روش های معادلات همزمان
۳۹۸	پاسخنامه فصل دوازدهم: اقتصاد سنجی ای سری زمانی یک
۴۰۵	پاسخنامه فصل سیزدهم: اقتصاد سنجی ای 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 سطح 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 حائیه که واقعا در آماده‌سازی و چاپ این اثر مرا یاری نموده‌اند، تشکر و قدردانی فراوان نمایم.

با تشکر

فرزانه میرزایی

Farzaneh.mirzaee23@yahoo.com