

مبانی اقتصادسنجی داده های پانل و کاربرد ای ویوز برای آن

تألیف:

دکتر محمد رضا شهباب

عضو هیات علمی دانشگاه

سرشناسه
عنوان و نام پدیدآور
مشخصات نشر
مشخصات ظاهری
شاب
وضعیت فهرست نویسی : فیا
یادداشت
موضوع
۱. اقتصادسنجی . ۲. Econometrics . ۳. اقتصادسنجی داده های پانل.
۴. Econometrics—Panel data. ۵. اقتصادسنجی -- نرم افزار EViews . ۶. Econometrics—
Views software ۷. کاربرد ای ویوز . ۸. اقتصادسنجی برای مقاطع کارشناسی ارشد دکتری.
شناسه افزوده
رده بندی کنگره
رده بندی دیویی
شماره کتابشناسی ملی

شهاب، محمدرضا، ۱۳۵۱ -
مبانی اقتصادسنجی داده های پانل و کاربرد ای ویوز برای آن /
محمدرضا شهاب .
سمنان: دانشگاه آزاد اسلامی، واحد سمنان، ۱۳۹۶.
۲۹۰ ص.
۹۷۸-۹۶۴-۱۰-۴۷۳۳-۹
کتابنامه: ص ۲۲۸-۲۹۰
۱. اقتصادسنجی . ۲. Econometrics . ۳. اقتصادسنجی داده های پانل.
۴. Econometrics—Panel data. ۵. اقتصادسنجی -- نرم افزار EViews . ۶. Econometrics—
Views software ۷. کاربرد ای ویوز . ۸. اقتصادسنجی برای مقاطع کارشناسی ارشد دکتری.
شناسه افزوده
رده بندی کنگره
رده بندی دیویی
شماره کتابشناسی ملی

مبانی اقتصادسنجی داده های پانل و کاربرد ای ویوز برای آن

مؤلف: دکتر محمدرضا شهاب

نوبت و تاریخ چاپ: ۱ / ۱۳۹۶

شمارگان: ۲۰۰۰ نسخه

چاپ و صحافی: دانشگاه آزاد اسلامی

ویراستار: زهرا کواکبیان

قیمت: ۲۳۰۰۰۰ ریال

کلیه حقوق این اثر برای مؤلفین و دانشگاه محفوظ است.

نشانی: سمنان - مجتمع دانشگاه آزاد اسلامی واحد سمنان

صندوق پستی ۱۷۹-۳۵۱۴۵ تلفن: ۰۲۳۳۳۶۵۴۰۴۰ نمابر- ۰۲۳۳۶۵۴۰۳

فهرست مطالب

۱	بخش اول: مبانی اقتصادسنجی داده های تلفیقی (پانل).....
۱	پیش در آمد بخش اول.....
۳	فصل اول: مفاهیم بنیادی در مورد داده های تلفیقی (پانل).....
۳	۱-۱: مقدمه: پژوهش اقتصادی.....
۵	۱-۲: مدل های اقتصادی و اقتصادسنجی.....
۷	۱-۳: داده های اقتصادی.....
۱۴	۱-۴: ریت های اقتصادسنجی داده های تلفیقی (پانل).....
۲۴	۱-۵: یک مثال گویا برای داده های تلفیقی: «مطالعه محیط کسب و کار».....
	فصل دوم: تعیین مدل های رگرسیونی داده های تلفیقی: با رویکرد اثرات
۲۹	مشترک (CF) و اثرات ثابت (FEM).....
۲۹	۲-۱: مقدمه: شکل عمومی و انواع مدل های رگرسیونی مبتنی بر داده های تلفیقی
۳۰	۲-۲: مدل های رگرسیونی داده های تلفیقی و حالت های مختلف در تخمین آن ها
۳۳	۲-۳: تخمین مدل رگرسیونی پانل با روش اثرات مشترک (CEM).....
۳۵	۲-۴: تخمین مدل رگرسیونی پانل با رویکرد اثرات ثابت (FEM).....
۴۳	۲-۵: آزمون تشخیصی وجود و معنی داری اثرات مفهومی با گروهی.....
۴۵	۲-۶: برآورد کننده های میان گروهی و بین گروهی.....
۵۲	۲-۷: اثرات گروهی (مقطعی) و زمانی ثابت.....
۵۵	۲-۸: رویکرد اثرات ثابت در پانل های نامتوازن.....
۵۶	۲-۹: ملاحظات در مورد جزء خطای ترکیبی در مدل اثرات ثابت.....
	فصل سوم: تخمین مدل های رگرسیونی داده های تلفیقی: با رویکرد اثرات
۵۸	تصادفی (REM).....
۵۸	۳-۱: مقدمه.....
۵۹	۳-۲: رویکرد اثرات تصادفی.....
۶۴	۳-۳: حداقل مربعات تعمیم یافته (GLS).....
۶۸	۳-۴: روش حداقل مربعات تعمیم یافته موقعی که λ نامعلوم است (FGLS) (روش

۷۳	 ۳-۵: انجام آزمون برای اثرات تصادفی
۷۴	 ۳-۶: آزمون تشخیصی هاسمن برای تعیین نوع اثرات
	فصل چهارم: گزیده هایی در مقوله اقتصادسنجی داده های تلفیقی (پانل):
۸۰	 برخی مباحث تکمیلی
۸۰	 ۴-۱: مقدمه
۸۰	 ۴-۲: اختلالات ناهموار
۸۱	 ۴-۲-۱: ناهمبستگی در مدل های پانل
۸۵	 ۴-۲-۲: همبستگی در مدل های پانل
۹۰	 ۴-۳: مسئله درونزایی رگرسورها در مدل های رگرسیونی پانل
۹۳	 ۴-۴: پانل های نابال
۹۴	 ۴-۴-۱: آزمون های ریشه واحد در پانل
۱۱۰	 ۴-۴-۲: آزمون های همجمعی در پانل
۱۱۳	بخش دوم: کاربرد نرم افزار ای ویور در اقتصادسنجی داده های تلفیقی (پانل)
۱۱۳	 پیش در آمد بخش دوم
۱۱۶	 فصل پنجم: کار با داده های تلفیقی در قالب ساختار پانل Pool
۱۱۶	 ۵-۱: مقدمه
۱۱۶	 ۵-۲: پنجره ای ویور و اجزاء آن
۱۲۲	 ۵-۳: وارد کردن داده های تلفیقی (پانل)
۱۴۰	 ۵-۴: کار با داده های تلفیقی
۱۴۱	 ۵-۴-۱: ایجاد موضوعات متعدد Pool در یک پرونده کاری
۱۴۳	 ۵-۴-۲: تولید یا ایجاد داده های تلفیقی جدید
۱۴۹	 ۵-۴-۳: ایجاد یک گروه از سری های تلفیقی
۱۵۰	 ۵-۴-۴: بررسی داده های تلفیقی
۱۵۳	 ۵-۴-۵: حذف، ذخیره، بازیابی و انتقال داده های تلفیقی
۱۵۵	 ۵-۴-۶: رسم نمودار داده های تلفیقی
	فصل ششم: محاسبه آماره های توصیفی و تخمین مدل رگرسیونی پانل (در

۱۵۹	 قالب ساختاربندی (Pool)
۱۵۹	
۱۵۹	 ۱-۶: مقدمه
	 ۲-۶: محاسبه آماره های توصیفی
۱۶۷	 ۳-۶: تخمین مدل رگرسیونی پانل در قالب Pool (به روش حداقل مربعات LS)
	 ۴-۶: تخمین مدل رگرسیونی پانل در قالب Pool (به روش حداقل مربعات دومرحله ای - متغیرهای ابزاری)
۱۸۶	 ۵-۶: اجرای آزمون های تشخیصی در قالب Pool
۱۸۸	 ۶-۶: اجرای آزمون های واحد و آزمون های همجمعی در قالب Pool
۱۹۱	 ۱-۶-۶: اجرای آزمون های ریشه واحد
۱۹۱	 ۲-۶-۶: اجرای آزمون های همجمعی
۱۹۳	 ۷-۶: سایر نکات مرتبط با تخمین مدل رگرسیونی پانل در قالب Pool
۱۹۵	 فصل هفتم: کار با داده های تلفیقی و تخمین مدل رگرسیونی در قالب ساختاربندی Panel
۲۰۰	
۲۰۰	 ۱-۷: مقدمه
	 ۲-۷: فرایند بکارگیری ساختار Panel در فایل کار و ورود داده های تلفیقی در این ساختار
۲۱۲	 ۳-۷: کار با داده های تلفیقی در ساختار Panel
۲۱۲	 ۱-۳-۷: روندهای زمانی در ساختار Panel
۲۱۵	 ۲-۳-۷: محاسبه برخی آماره های مهم در قالب ساختار Panel
	 ۳-۳-۷: محاسبه و ذخیره آماره های خاص مقطعی و آماره های خاص دوره ای از طریق ایجاد صفحات جدید در ساختار Panel
۲۲۳	 ۴-۳-۷: رسم نمودارها در قالب ساختار Panel
۲۲۸	 ۵-۳-۷: تحلیل داده های تلفیقی انباشته شده در ساختار Panel
۲۲۹	 ۴-۷: برآورد مدل رگرسیونی در قالب ساختار Panel: روش حداقل مربعات
۲۳۵	

۲۴۱		۵-۷: برآورد مدل رگرسیونی در قالب ساختار Panel : روش
۲۴۳		۶-۷: انجام آزمون های تشخیصی در قالب ساختار Panel
۲۴۳		۱-۶-۷: آزمون چاو (آزمون لیمر)
۲۴۶		۲-۶-۷: آزمون هاسمن
۲۴۸		۳-۶-۷: آزمون های ضریب لاگرانژ (LM)
۲۵۱		۷-۷: انجام آزمون های ریشه واحد و همجمعی در قالب ساختار Panel ...
۲۵۱		۱-۷-۷: آزمون ریشه واحد پانل
۲۵۳		۲-۷-۷: آزمون های همبستگی پانل
۲۵۶		۸-۷: انجام سایر آزمون های مفید در ساختار Panel
۲۵۶		۱-۸-۷: آزمون وجود خود همبستگی سریالی $AR(1)$
۲۵۷		۲-۸-۷: آزمون متغیرهای حذف شده
۲۶۱		۳-۸-۷: آزمون متغیرهای زائد
۲۶۳		فهرست منابع

پیشگفتار

امروزه آشنایی با اقتصادسنجی و ابزارها و تکنیک‌های آن و کاربرد آن به‌عنوان وسیله‌ای قوی و کارآمد، در بسیاری از مطالعات و پژوهش‌های علمی نه‌تنها در رشته علوم اقتصادی و شاخه‌ها و گرایش‌های مختلف آن از ضروریات حتمی و گریزناپذیر است، بلکه در سایر رشته‌ها نظیر مدیریت در تمامی گرایش‌های صنعتی، اجرایی، بازرگانی، دولتی و...، حسابداری و مدیریت مالی، روان‌شناسی و جامعه‌شناسی، برنامه‌ریزی منطقه‌ای و شهری، مهندسی صنایع، عمران، کشاورزی و... نیز ضرورت دارد. این ضرورت به‌ویژه برای مدل‌سازی و درک و تحلیل وضعیت موجود و پیش‌بینی روندهای جزئی و کلی آن و نیز برای شناخت مکانیزم تحولات و سیاست‌گذاری‌های مناسب و درست، اهمیتی جدی‌تر یافته می‌یابد. از سوی دیگر، مفاهیم و تکنیک‌های اقتصادسنجی به‌عنوان شاخه‌ای دایر در دانش اقتصاد نظیر سایر رشته‌های علوم و به‌خصوص علوم انسانی، سیر تحول و فرایند تکاملی پرفراز و نشیبی را طی کرده و همواره بخش عمده‌ای از مطالعات به این حوزه اختصاص داشته است. طی دهه‌های اخیر با شکل‌گیری شعبه‌های پرکاربردی نظیر اقتصادسنجی داده‌های تلفیقی (پانل) بر سرعت و عمق این فرایند تکاملی بیش‌ازپیش افزوده شده است. باوجوداین، گرچه طی سال‌های اخیر کتاب‌های متعددی در زمینه اقتصادسنجی به زبان فارسی به چاپ رسیده است، اکثر کتاب‌های موجود، به‌صورت کلی به مباحث اقتصادسنجی پرداخته و فقط نمونه‌های اندکی درخور معرفی است که به اقتصادسنجی داده‌های پانل پرداخته باشند. علاوه‌بر این نیازها و ضرورت‌های خاص، پژوهش‌های علمی در کشورهای مختلف و به‌ویژه کشورهای درحال‌توسعه مستلزم مهیاکردن دانش‌آموختگانی است که بتوانند از برنامه‌ها و بسته‌های نرم‌افزاری مناسب در تحقیقات اقتصادی و مدیریتی استفاده کنند. براین‌اساس یکی از امتیازات کتاب حاضر این است که ضمن ارائه مباحث نظری موردنیاز در حیطه اقتصادسنجی داده‌های تلفیقی (پانل) در بخش اول، مباحثی کاربردی نیز درخصوص نحوه استفاده از جدیدترین نسخه نرم‌افزار ای ویوز، ای به‌عنوان رایج‌ترین بسته نرم‌افزاری اقتصادسنجی، ارائه می‌دهد و در عین سادگی، نسبت به

کتاب‌های مشابه دیگر، در ارائه مجموعه مباحث، جامع‌تر و کامل‌تر و از حیث نسخه نرم‌افزاری مذکور جدیدتر است. درواقع، تلفیق مباحث نظری با مباحث نرم‌افزاری و تجمیع آن‌ها در قالب یک کتاب و تبیین آن‌ها به زبانی تا حد ممکن ساده، هدفی اساسی است که در این کتاب دنبال شده و تأکید مؤلف بر این بوده است که دانشجویان مقاطع تحصیلات تکمیلی و محققان، در حداقل زمان، مبانی و مقدمات لازم درخصوص اقتصادسنجی داده‌های تلفیقی (پانل) را فراگرفته و در عمل بتوانند برای اجرای مدل‌های رگرسیونی پانل، از جدیدترین و عالی‌ترین نسخه نرم‌افزار ای ویوز، آزمون‌ها و سایر امکانات این بسته نرم‌افزاری حداکثر بهره را ببرند.

ضمن اذعان به اینکه تئوری‌های ماری از عیب و نقص ارائه نشده، امیدوارم محتوای این کتاب برای دانشجویان کارشناسی ارشد، دکتری، پژوهشگران و محققان مفید باشد. از نظرات اصلاحی و سازنده شما پیمان استقبال کرده و به آن‌ها ارج می‌نهم.

دکتر محمدرضا شهاب

عضو هیئت علمی دانشگاه

تایستان ۱۳۹۵