

فهرست مطالب

فصل اول. انواع داده‌ها و منابع گردآوری آنها

۱-۱	مقدمه	۱
۲-۱	انواع طبقه‌بندی داده‌ها	۳
۱-۲-۱	انواع داده‌ها برحسب منبع تولید	۳
۱-۱-۲-۱	داده‌های حسابداری	۳
۲-۱-۲-۱	داده‌های بازار	۴
۳-۱-۲-۱	داده‌های اقتصادی	۶
۲-۲-۱	انواع داده‌ها برحسب بُعد تغییرات	۶
۱-۲-۲-۱	داده‌های مقطعی	۶
۲-۲-۲-۱	داده‌های سری‌زمانی	۷
۳-۲-۲-۱	داده‌های ترکیبی	۸
۳-۲-۱	انواع داده‌ها برحسب مقیاس سنجش	۹
۱-۳-۲-۱	داده‌ها با مقیاس اسمی	۹
۲-۳-۲-۱	داده‌ها با مقیاس رتبه‌ای	۹
۳-۳-۲-۱	داده‌ها با مقیاس فاصله‌ای	۱۰
۴-۳-۲-۱	داده‌ها با مقیاس نسبی	۱۰
۳-۱	جامعه و نمونه آماری در پژوهش‌های حسابداری	۱۱
۴-۱	رفتار با مشاهدات مفقود	۱۳
۵-۱	نکات کلیدی فصل	۱۳

فصل دوم. معرفی نرم‌افزار Eviews

۱-۲	مقدمه	۱۵
۲-۲	محیط کاربری نرم‌افزار EViews	۱۶
۳-۲	منابع موجود برای فراگیری نرم‌افزار EViews	۱۸
۴-۲	ریزبرنامه‌های EViews (Add-ins)	۱۹
۵-۲	نکات کلیدی فصل	۲۰

فصل سوم. انتقال داده‌ها به Eviews و آزمون‌های مقدماتی

۱-۳	مقدمه	۲۳
۲-۳	انتقال داده‌ها به نرم‌افزار EViews	۲۴
۱-۲-۳	انتقال داده‌های مقطعی به نرم‌افزار EViews	۲۴
۲-۲-۳	انتقال داده‌های سری‌زمانی به نرم‌افزار EViews	۲۷
۱-۲-۲-۳	داده‌های سری‌زمانی با تواتر سالانه	۲۷
۲-۲-۲-۳	داده‌های سری‌زمانی با تواتر ماهانه	۲۹

۳۱	انتقال داده‌های ترکیبی (متوازن و غیرمتوازن) به نرم‌افزار EViews
۳۱	انتقال داده‌های ترکیبی متوازن به EViews
۴۲	انتقال داده‌های ترکیبی نامتوازن به نرم‌افزار EViews
۴۵	انجام محاسبات اولیه
۴۶	انجام محاسبات با ابزار gen
۴۶	انجام محاسبات با خط فرمان
۴۷	انجام محاسبات با برنامه‌نویسی
۵۰	رسم نمودارها
۵۲	چگونگی رفتار با مشاهدات پرت
۵۴	حذف و ویرایش مشاهدات پرت در EViews
۵۸	تهیه جدول آماره‌های توصیفی
۶۰	آزمون جارکو- برا
۶۰	تهیه آماره‌های توصیفی برای بخشی از مشاهدات
۶۲	تهیه جدول ضرایب همبستگی
۶۶	آزمون‌های آماری مقدماتی
۶۶	آزمون‌های مقایسه (میانگین، واریانس و میانه) تک نمونه‌ای
۶۹	آزمون‌های مقایسه (میانگین، واریانس و میانه) دو یا چند نمونه‌ای
۷۰	نکات کلیدی فصل

فصل چهارم. مفاهیم مقدماتی تحلیل رگرسیون

۷۳	۱-۴ مقدمه
۷۴	۲-۴ رگرسیون چیست؟
۷۵	۱-۲-۴ تفاوت رگرسیون و همبستگی
۷۵	۲-۲-۴ رابطه یا تأثیر؟
۷۶	۳-۴ برآورد مدل رگرسیون در EViews
۸۲	۱-۳-۴ برآورد مدل (۱-۳) بدون عرض از مبدأ
۸۳	۲-۳-۴ محاسبه ضرایب استاندارد شده
۸۳	۳-۳-۴ برآورد مدل (۱-۳) با اعمال محدودیت روی ضرایب - رگرسیون مقید
۸۴	۴-۳-۴ آزمون‌های خطی روی ضرایب مدل
۸۷	۵-۳-۴ برآورد مدل در گروه‌های مختلف بدون کدنویسی
۸۸	۶-۳-۴ برآورد مدل در گروه‌های مختلف با کدنویسی
۸۹	۴-۴ آزمون مقایسه زوجی با استفاده از رگرسیون
۸۹	۱-۴-۴ مقایسه بدون لحاظ اثر متغیرهای دیگر
۹۱	۲-۴-۴ مقایسه با لحاظ اثر متغیرهای دیگر
۹۳	۵-۴ استخراج مقدار برازش شده متغیر وابسته و باقیمانده‌های مدل
۹۴	۶-۴ نکات کلیدی فصل

فصل پنجم. فروض کلاسیک رگرسیون و آزمون‌های تشخیصی

- ۹۷-۱-۵ فروض کلاسیک رگرسیون کدامند؟
- ۹۸-۱-۱-۵ فرض اول: میانگین خطاها، صفر است.
- ۹۹-۱-۱-۱-۵ نحوه آزمون فرض کلاسیک اول رگرسیون و رفع مشکل
- ۱۰۰-۲-۱-۵ فرض دوم: واریانس خطاها، مقدار ثابتی دارد.
- ۱۰۰-۱-۲-۱-۵ شناسایی مشکل ناهمسانی واریانس
- ۱۰۱-۲-۲-۱-۵ رفع مشکل ناهمسانی واریانس
- ۱۰۳-۳-۱-۵ فرض سوم: بین باقیمانده‌ها، خودهمبستگی وجود ندارد.
- ۱۰۴-۱-۳-۱-۵ شناسایی مشکل خودهمبستگی سریالی
- ۱۰۶-۲-۳-۱-۵ رفع مشکل خودهمبستگی سریالی
- ۱۱۰-۳-۳-۱-۵ رفع مشکل همزمان ناهمسانی واریانس و خودهمبستگی سریالی
- ۱۱۲-۴-۱-۵ فرض چهارم: بین خطاها و متغیرهای توضیحی، همبستگی وجود ندارد.
- ۱۱۳-۵-۱-۵ فرض پنجم: توزیع آماری جمله خطا، نرمال است.
- ۱۱۷-۲-۵ مفهوم همخطی
- ۱۱۸-۱-۲-۵ شناسایی همخطی
- ۱۱۹-۲-۲-۵ رفع مشکل همخطی
- ۱۲۰-۱-۲-۲-۵ استفاده از تکنیک رگرسیون مرزی
- ۱۲۵-۳-۲-۵ در چه مواقعی می‌توان همخطی را نادیده گرفت؟
- ۱۲۶-۳-۵ مفهوم تصریح مدل
- ۱۲۹-۴-۵ مدل‌سازی و تعیین مدل بهینه
- ۱۲۹-۱-۴-۵ مدل‌سازی براساس یک تئوری پشتیبان
- ۱۳۰-۲-۴-۵ مدل‌سازی بدون تئوری پشتیبان (داده‌کاوی)
- ۱۳۰-۳-۴-۵ ایجاد مدل بهینه در EViews
- ۱۳۲-۵-۵ برخی آزمون‌های خاص
- ۱۳۲-۱-۵-۵ مقایسه توان تبیین دو مدل غیرآشیا‌های (ونگ، ۱۹۸۹)
- ۱۳۵-۲-۵-۵ مقایسه توان تبیین یک مدل در دو نمونه مستقل (کرامر، ۱۹۸۷)
- ۱۳۹-۳-۵-۵ مقایسه ضرایب یک مدل در دو نمونه مستقل
- ۱۳۹-۱-۳-۵-۵ رویکرد پترن‌ستر و همکاران (۱۹۹۸)
- ۱۴۱-۲-۳-۵-۵ بکارگیری متغیرهای مجازی در مدل رگرسیون
- ۱۴۳-۶-۵ نحوه ورود متغیر تعدیل‌گر به مدل رگرسیون
- ۱۴۵-۷-۵ نکات کلیدی فصل

فصل ششم. مدل‌سازی سری‌های زمانی تک‌متغیره

- ۱۴۷-۱-۶ مقدمه
- ۱۴۸-۲-۶ انواع فرایندهای سری‌زمانی

۱۴۸	۱-۲-۶ فرآیند خودتوضیح (AR)
۱۴۸	۲-۲-۶ فرآیند میانگین متحرک (MA)
۱۴۹	۳-۲-۶ فرآیند خودتوضیح میانگین متحرک (ARMA)
۱۴۹	۴-۲-۶ مفهوم مانایی (عدم وجود ریشه واحد) یک فرآیند خودتوضیح
۱۵۰	۳-۶ مدل سازی سری های زمانی
۱۵۱	۱-۳-۶ تعیین درجه انباشتگی سری زمانی (آزمون ریشه واحد)
۱۵۶	۲-۳-۶ تعیین نوع فرآیند و مرتبه آن در سری های زمانی
۱۵۹	۳-۳-۶ تعیین نوع فرآیند و مرتبه سری tepix در EViews
۱۶۲	۴-۳-۶ پیش بینی مقادیر tepix با استفاده از مدل به دست آمده
۱۶۲	۱-۴-۳-۶ پیش بینی درون نمونه ای
۱۶۴	۲-۴-۳-۶ پیش بینی برون نمونه ای
۱۶۶	۴-۶ تعیین نوع و مرتبه فرآیند جمله خطا در مدل های ساده
۱۶۹	۵-۶ نکات کلیدی فصل

فصل هفتم. مدل سازی فرآیند خودتوضیح ناهمسانی واریانس شرطی

۱۷۱	۱-۷ مقدمه
۱۷۲	۱-۱-۷ فرآیند خودتوضیح ناهمسانی واریانس شرطی مرتبه q
۱۷۳	۲-۱-۷ فرآیند خودتوضیح ناهمسانی واریانس شرطی تعمیم یافته مرتبه p
۱۷۳	۳-۱-۷ فرآیند خودتوضیح ناهمسانی واریانس شرطی تعمیم یافته مرتبه (q,p)
۱۷۳	۲-۷ مدل سازی با رویکرد ARCH و GARCH
۱۷۴	۱-۲-۷ بررسی وجود اثرات ARCH
۱۷۷	۲-۲-۷ برآورد معادله های میانگین و واریانس شرطی
۱۸۰	۳-۲-۷ پیش بینی مقادیر tepix با استفاده از مدل به دست آمده
۱۸۰	۱-۳-۲-۷ پیش بینی درون نمونه ای
۱۸۱	۲-۳-۲-۷ پیش بینی برون نمونه ای
۱۸۲	۳-۷ سایر الگوهای معروف ناهمسانی واریانس شرطی
۱۸۲	۱-۳-۷ سایر الگوها با توجه به معادله میانگین
۱۸۲	۱-۱-۳-۷ مدل GARCH_M
۱۸۵	۲-۳-۷ سایر الگوها با توجه به معادله واریانس
۱۸۵	۱-۲-۳-۷ مدل TARCH
۱۸۶	۲-۲-۳-۷ مدل EGARCH
۱۸۷	۳-۲-۳-۷ مدل PARCH/PGARCH
۱۹۰	۳-۳-۷ با توجه به معادله میانگین و واریانس شرطی
۱۹۰	۴-۷ ترکیب الگوهای ARIMA با الگوهای ARCH و GARCH
۱۹۳	۵-۷ نکات کلیدی فصل

فصل هشتم. مدل‌سازی سری‌های زمانی چندمتغیره

۱۹۵	۱-۸ مقدمه
۱۹۷	۱-۱-۸ مفهوم همجمعی (هم‌انباشتگی)
۱۹۸	۲-۸ مفاهیم نظری رویکرد تصحیح خطای برداری (VAR)
۱۹۸	۱-۲-۸ برآورد مدل با رویکرد VAR در EViews
۱۹۹	۱-۱-۲-۸ تعیین درجه انباشتگی متغیرها
۲۰۱	۲-۱-۲-۸ تعیین تعداد وقفه بهینه برای آزمون همجمعی
۲۰۴	۳-۱-۲-۸ انجام آزمون همجمعی ژوهانسن
۲۰۵	۴-۱-۲-۸ برآورد روابط کوتاه‌مدت بین tepix و er
۲۱۰	۵-۱-۲-۸ تابع پاسخ تکانه (IRF)
۲۱۱	۳-۸ مفاهیم نظری رویکرد خودتوضیح برداری (VEC)
۲۱۲	۱-۳-۸ برآورد مدل با رویکرد VEC در EViews
۲۱۳	۱-۱-۳-۸ تعیین درجه انباشتگی متغیرها
۲۱۵	۲-۱-۳-۸ تعیین تعداد وقفه بهینه برای آزمون همجمعی
۲۱۶	۳-۱-۳-۸ انجام آزمون همجمعی ژوهانسن
۲۱۷	۴-۱-۳-۸ برآورد روابط بلندمدت و کوتاه‌مدت بین سری‌های lbvdps و lp
۲۱۹	۴-۸ مفاهیم نظری رویکرد خودتوضیح با وقفه‌های توزیعی (ARDL)
۲۲۰	۱-۴-۸ برآورد مدل با رویکرد ARDL در EViews
۲۲۲	۱-۱-۴-۸ آزمون رابطه بلندمدت (Bounds Test)
۲۲۳	۲-۱-۴-۸ استخراج جمله تصحیح خطا (ECT) و مقادیر برازش شده lp
۲۲۴	۵-۸ مفاهیم نظری رویکرد خودتوضیح برداری پایه (Basic VAR)
۲۲۴	۱-۵-۸ برآورد مدل با رویکرد Basic VAR در EViews
۲۲۵	۱-۱-۵-۸ تعیین درجه انباشتگی متغیرها
۲۲۵	۲-۱-۵-۸ تعیین تعداد وقفه بهینه برای استفاده در Basic VAR
۲۲۷	۳-۱-۵-۸ برآورد روابط بین سری‌های mv و e
۲۲۸	۶-۸ پیش‌بینی در VAR
۲۳۰	۷-۸ رگرسیون غلتان
۲۳۲	۸-۸ نکات کلیدی فصل

فصل نهم. رگرسیون کوانتایل و رگرسیون استوار

۲۳۳	۱-۹ مقدمه
۲۳۴	۲-۹ رگرسیون کوانتایل
۲۳۵	۱-۲-۹ برآورد رگرسیون کوانتایل در EViews
۲۳۶	۱-۱-۲-۹ برآورد مدل (۱-۹) در یک چندک‌های خاص
۲۳۸	۲-۱-۲-۹ برآورد مدل (۱-۹) در چندک‌های مختلف
۲۴۱	۳-۱-۲-۹ مقایسه ضریب در چندک‌های متفاوت

۲۴۲ ۴-۱-۲-۹ مقایسه ضریب در چندک‌های متقارن
۲۴۴ ۳-۹ رگرسیون استوار
۲۴۵ ۱-۳-۹ برآورد رگرسیون استوار در EViews
۲۴۶ ۱-۱-۳-۹ برآورد مدل (۱-۹) با رویکرد M
۲۴۸ ۲-۱-۳-۹ برآورد مدل (۱-۹) با رویکرد S
۲۴۹ ۳-۱-۳-۹ برآورد مدل (۱-۹) با رویکرد MM
۲۵۰ ۴-۹ نکات کلیدی فصل

فصل دهم. رگرسیون با متغیرهای ابزاری و معادلات همزمان

۲۵۲ ۱-۱۰ مقدمه
۲۵۲ ۲-۱۰ متغیرهای درون‌زا، برون‌زا و متغیرهای ابزاری
۲۵۳ ۳-۱۰ ویژگی‌های مناسب برای متغیر ابزاری
۲۵۴ ۴-۱۰ مدل‌سازی متغیرهای ابزاری
۲۵۷ ۵-۱۰ برآورد مدل با متغیرهای ابزاری در EViews
۲۵۷ ۱-۵-۱۰ رگرسیون با متغیرهای ابزاری - رویکرد 2SLS
۲۵۹ ۱-۱-۵-۱۰ آزمون درون‌زایی متغیرها - رویکرد 2SLS
۲۶۰ ۲-۱-۵-۱۰ آزمون اعتبار ابزارها - رویکرد 2SLS
۲۶۱ ۳-۱-۵-۱۰ آزمون ارتباط ابزارها و شناسایی ابزار ضعیف - رویکرد 2SLS
۲۶۴ ۲-۵-۱۰ رگرسیون با متغیرهای ابزاری - رویکرد GMM
۲۶۴ ۱-۲-۵-۱۰ آزمون درون‌زایی متغیرها - رویکرد GMM
۲۶۶ ۲-۲-۵-۱۰ آزمون اعتبار ابزارها - رویکرد GMM
۲۶۷ ۳-۲-۵-۱۰ آزمون ارتباط ابزارها و شناسایی ابزار ضعیف - رویکرد GMM
۲۶۸ ۳-۵-۱۰ رگرسیون با متغیرهای ابزاری - رویکرد LIML
۲۷۱ ۶-۱۰ معادلات همزمان
۲۷۱ ۱-۶-۱۰ برآورد معادلات همزمان در EViews
۲۷۳ ۱-۱-۶-۱۰ برآورد معادلات همزمان با رویکرد SUR
۲۷۵ ۲-۱-۶-۱۰ برآورد معادلات همزمان با رویکرد 3SLS
۲۷۶ ۷-۱۰ نکات کلیدی فصل

فصل یازدهم. مدل با متغیر وابسته دو ارزشی و رتبه‌ای

۲۷۹ ۱-۱۱ مقدمه
۲۸۰ ۲-۱۱ مفاهیم نظری در خصوص برآورد مدل با متغیر وابسته دو ارزشی
۲۸۱ ۳-۱۱ برآورد مدل با متغیر وابسته دو ارزشی
۲۸۱ ۱-۳-۱۱ رویکرد لاجیت
۲۸۳ ۲-۳-۱۱ رویکرد پرابیت
۲۸۴ ۳-۳-۱۱ رویکرد مدل گامپیت (ارزش بحرانی)

۲۸۴ ۴-۳-۱۱ آزمون در خصوص ضرایب مدل
۲۸۵ ۵-۳-۱۱ عدم برقراری فروض کلاسیک در مدل‌هایی با متغیر وابسته دو ارزشی
۲۸۶ ۴-۱۱ آزمون‌های نیکویی برازش
۲۸۶ ۱-۴-۱۱ ضریب تعیین مک‌فادن
۲۸۶ ۲-۴-۱۱ آزمون‌های هاسمر-لمشو و اندروز
۲۸۸ ۳-۴-۱۱ معیار درصد صحت پیش‌بینی
۲۸۹ ۵-۱۱ محاسبه احتمال رخداد حالت $y = 1$
۲۹۱ ۶-۱۱ مدل با متغیر وابسته رتبه‌ای
۲۹۱ ۱-۶-۱۱ مدل‌سازی و نحوه برآورد
۲۹۲ ۲-۶-۱۱ برآورد مدل با متغیر وابسته رتبه‌ای
۲۹۲ ۱-۲-۶-۱۱ رویکرد لاجیت رتبه‌ای
۲۹۴ ۲-۲-۶-۱۱ رویکرد پرابیت رتبه‌ای
۲۹۵ ۳-۶-۱۱ محاسبه احتمال رخداد حالت $y = i$
۲۹۶ ۷-۱۱ نکات کلیدی فصل

فصل دوازدهم. مدل منقطع، سانسور شده و مفهوم تورش انتخاب نمونه

۲۹۷ ۱-۱۲ مقدمه
۲۹۸ ۲-۱۲ مدل رگرسیونی با متغیر وابسته منقطع و سانسور شده
۲۹۹ ۱-۲-۱۲ برآورد مدل رگرسیونی با متغیر وابسته منقطع در EViews
۳۰۲ ۲-۲-۱۲ برآورد مدل رگرسیونی با متغیر وابسته سانسور شده در EViews
۳۰۳ ۳-۱۲ تورش انتخاب نمونه
۳۰۵ ۱-۳-۱۲ رویکرد مدل انتخاب هکمن
۳۱۱ ۴-۱۲ نکات کلیدی فصل

فصل سیزدهم. مدل با داده‌های ترکیبی - مباحث مقدماتی

۳۱۴ ۱-۱۳ مقدمه
۳۱۵ ۲-۱۳ مفاهیم نظری داده‌های ترکیبی
۳۱۵ ۱-۲-۱۳ مدل اثرات مشترک
۳۱۶ ۲-۲-۱۳ مدل اثرات فردی
۳۱۷ ۳-۲-۱۳ مدل اثرات ثابت و مدل اثرات تصادفی
۳۱۷ ۳-۱۳ اثرات مشترک، ثابت یا تصادفی؟
۳۱۹ ۱-۳-۱۳ داده‌های ترکیبی متوازن و نامتوازن
۳۲۱ ۲-۳-۱۳ اجرای آزمون‌های انتخاب الگو
۳۲۶ ۴-۱۳ آزمون فروض کلاسیک
۳۲۶ ۱-۴-۱۳ انتخاب الگوی مناسب برآورد مدل (۵-۱۳)

۳۲۶ ۱۳-۴-۲ فرض اول: میانگین خطاها، صفر است.
۳۲۷ ۱۳-۴-۳ فرض دوم: واریانس خطاها، مقدار ثابتی دارد.
۳۲۷ ۱۳-۴-۱ آزمون ناهمسانی واریانس
۳۳۱ ۱۳-۴-۲ رفع مشکل ناهمسانی واریانس
۳۳۲ ۱۳-۴-۴ فرض سوم: بین مقادیر جمله خطا، خودهمبستگی وجود ندارد.
۳۳۲ ۱۳-۴-۴ آزمون خودهمبستگی سریالی
۳۳۵ ۱۳-۴-۴ رفع مشکل خودهمبستگی سریالی
۳۳۵ ۱۳-۴-۳ رفع همزمان ناهمسانی واریانس و خودهمبستگی سریالی
۳۳۷ ۱۳-۴-۵ فرض چهارم: بین جمله خطا و متغیرهای توضیحی، همبستگی وجود ندارد.
۳۳۷ ۱۳-۴-۶ فرض پنجم: توزیع آماری جمله خطا، نرمال است.
۳۳۸ ۱۳-۵ وابستگی مقطعی جمله خطا
۳۳۸ ۱۳-۵-۱ شناسایی وابستگی مقطعی
۳۳۹ ۱۳-۵-۲ رفع مشکل وابستگی مقطعی
۳۳۹ ۱۳-۶ همخطی در داده‌های ترکیبی
۳۴۰ ۱۳-۶-۱ شناسایی همخطی در داده‌های ترکیبی
۳۴۱ ۱۳-۶-۲ رفع همخطی در داده‌های ترکیبی
۳۴۲ ۱۳-۷ کنترل اثرات سال‌ها و صنایع
۳۴۵ ۱۳-۸ برآورد مدل‌های اقلام تعهدی در سطح سال و صنعت
۳۴۷ ۱۳-۹ آزمون‌های ونگ (۱۹۸۹) و کرامر (۱۹۸۷) با داده‌های ترکیبی
۳۴۷ ۱۳-۱۰ نکات کلیدی فصل

فصل چهاردهم. مدل با داده‌های ترکیبی - مباحث تکمیلی

۳۴۹ ۱۴-۱ مقدمه
۳۵۰ ۱۴-۲ متغیرهای ابزاری با داده‌های ترکیبی
۳۵۴ ۱۴-۳ معادلات همزمان با داده‌های ترکیبی
۳۵۷ ۱۴-۳-۱ آزمون میشکین (۱۹۸۳)
۳۶۱ ۱۴-۴ داده‌های ترکیبی (پنل) پویا
۳۶۸ ۱۴-۵ ریشه واحد و همجمعی با داده‌های ترکیبی
۳۶۸ ۱۴-۵-۱ آزمون‌های ریشه واحد در داده‌های ترکیبی
۳۶۹ ۱۴-۵-۲ آزمون همجمعی در داده‌های ترکیبی
۳۶۹ ۱۴-۵-۳ مدل خودتوضیح برداری با داده‌های ترکیبی
۳۷۸ ۱۴-۶ رگرسیون دو مرحله‌ای فاما - مک‌بث (۱۹۷۳)
۳۸۲ ۱۴-۷ نکات کلیدی فصل
۳۸۵ پیوست‌ها
۴۰۱ منابع و ماخذ