

فهرست مطالب

بخش دو ۲۱۹
 نقض فروض مدل کلاسیک ۲۱۹
 بخش دوم ۲۲۰
 نقض فروض مدل کلاسیک ۲۲۰

فصل دهم ۲۲۴

همخطی ۲۲۴
 ۱-۱- ماهیت همخطی ۲۲۴
 ۱-۲- تخمین در حالت وجود همخطی کامل ۲۲۷
 ۱-۳- تخمین در حالت وجود همخطی «شدید» اما «غیر کامل» ۲۲۹
 ۱-۴- همخطی: درد سر زیاد برای هیچ؟ نتایج نظری همخطی ۲۳۰
 ۱-۵- نتایج عملی همخطی ۲۳۲
 ۱-۶- مثال نمونه: ۲۳۷
 مخارج مصرفی در ارتباط با درآمد و ثروت ۲۳۷
 ۱-۷- کشف همخطی ۲۴۱
 ۱-۸- اقدامات ممکن جهت رفع مشکلات همخطی ۲۴۵
 ۱-۹- آیا همخطی الزاماً زیان‌آور است؟ ۲۵۱
 اگر هدف پیش‌بینی است در این صورت شاید این طور نباشد ۲۵۱
 ۱-۱۰- خلاصه و نتایج ۲۵۲
 تمرینات فصل دهم ۲۵۴
 ۱-۱۱- رگرسیون مرحله به مرحله ۲۵۷
 پی‌نویس ۲۶۲

فصل یازدهم ۲۶۶

ناهمسانی واریانس ۲۶۶
 ۱-۱- ماهیت ناهمسانی واریانس ۲۶۶
 ۱-۲- تخمین OLS در صورت وجود ناهمسانی واریانس ۲۷۱
 ۱-۳- روش حداقل مربعات تعمیم‌یافته (GLS) ۲۷۳
 تفاوت میان GLS و OLS ۲۷۵
 ۱-۴- نتایج و کاربرد روش OLS در شرایط وجود ناهمسانی واریانس ۲۷۷

۲۷۹	۱۱-۵ - کشف ناهمسانی واریانس
۲۸۸	یک مثال تشریحی
۲۹۰	۱۱-۶ - اقدامات ممکن جهت رفع مشکل
۲۹۵	۱۱-۷ - خلاصه و نتایج
۲۹۷	تمرینات فصل یازدهم
۵۰۸	ضمیمه فصل یازدهم
۵۱۰	پی‌نویس
۵۱۳	فصل دوازدهم
۵۱۳	خود همبستگی
۵۱۳	۱۲-۱ - ماهیت مسأله
۵۲۱	۱۲-۳ - تخمین OLS در حالت وجود خود همبستگی
۵۲۳	۱۲-۳ - بهترین تخمین‌زن خطی بدون تورش کارآ (BLUE) در شرایط وجود همبستگی
۵۲۴	همبستگی
۵۲۵	۱۲-۴ - نتایج استفاده از OLS در حالت وجود خود همبستگی
۵۳۲	۱۲-۵ - کشف خود همبستگی
۵۴۵	۱۲-۶ - اقدامات درمانی
۵۵۶	۱۲-۸ - خلاصه و نتایج
۵۵۸	تمرینات فصل دوازدهم
۵۷۴	فصل سیزدهم
۵۷۴	مدلسازی اقتصادسنجی I
۵۷۴	متدولوژی اقتصادسنجی سنتی
۵۷۵	۱۳-۱ - خصوصیات یک مدل خوب
۵۷۷	۱۳-۲ - انواع خطای تصریح
۵۷۹	۱۳-۳ - نتایج خطای تصریح
۵۸۳	۱۳-۴ - آزمونهای کشف خطای تصریح
۵۹۱	سایر آزمونهای خطای تصریح
۵۹۲	۱۳-۵ - آزمون خطای تعیین غلط مدل
۵۹۳	مثال نمونه: مدل سنت‌لویس
۵۹۴	تخمین ضریب

۵۹۵ ۱۳-۶ - خطای در اندازه‌گیری و سنجش

۵۹۵ خطا در اندازه‌گیری و سنجش متغیر وابسته Y

۵۹۶ خطای در اندازه‌گیری و سنجش متغیر توضیحی X

۵۹۹ مثال ::

۵۹۹ خطا در اندازه‌گیری در متغیر وابسته Y به تنهایی

۶۰۰ خطا در اندازه‌گیری متغیر X

۶۰۱ ۱۳-۷ - خلاصه و نتایج

۶۰۳ تمرینات فصل سیزدهم

۶۰۸ ضمیمه ۱۳ - الف

۶۱۲ پی‌نویس

۶۱۵ فصل چهاردهم

۶۱۵ مدل‌سازی اقتصادسنجی II

۶۱۵ متدولوژی‌های اقتصادسنجی آلترناتیو

۶۱۶ ۱۴-۱ رهیافت لیمر در انتخاب مدل

۶۲۰ ۱۴-۲ رهیافت هندری در انتخاب مدل

۶۲۳ ۱۴-۳ آزمون‌های تشخیص عارضه‌ای منتخب

۶۲۴ ۱۴-۴ آزمون‌های فرضیات غیر متداخل

۶۳۲ ۱۴-۵ خلاصه و نتیجه‌گیری

۶۳۳ تمرینات فصل چهاردهم

۶۳۴ پی‌نویس

۶۳۵ پی‌نویس

۶۳۹ بخش سوم

۶۳۹ مباحثی چند در اقتصادسنجی

۶۴۲ فصل پانزدهم

۶۴۲ رگرسیون بر روی متغیرهای موهومی

۶۴۲ ۱۵-۱ ماهیت متغیرهای موهومی

۶۴۶ ۱۵-۲ رگرسیون روی یک متغیر کمی و یک متغیر کیفی با دو گروه یا طبقه

۶۵۰ ۱۵-۳ رگرسیون روی یک متغیر کمی و یک متغیر کیفی با بیش از دو طبقه

۶۵۲ ۱۵-۴ رگرسیون روی یک متغیر کمی و دو متغیر کیفی

۱۵-۵- مثال ۳-۱۵: اقتصاد معیشتی افراد دارای بیش از یک شغل..... ۶۵۴

۱۵-۶- مقایسه دو رگرسیون: ایده اساسی..... ۶۵۵

۱۵-۷- مقایسه دو رگرسیون - آزمون چاو..... ۶۵۷

۱۵-۸- مقایسه دو رگرسیون: روش متغیرهای موهومی..... ۶۶۱

۱۵-۹- مقایسه دو رگرسیون: مثالی دیگر..... ۶۶۳

۱۵-۱۰- اثرات متقابل..... ۶۶۶

۱۵-۱۱- کاربرد متغیرهای موهومی در تحلیل فصلی..... ۶۶۷

۱۵-۱۲- رگرسیون خطی قطعه‌ای..... ۶۷۰

۱۵-۱۳- خلاصه و نتایج..... ۶۷۳

پی‌نویس..... ۶۸۸

فصل شانزدهم..... ۶۹۱

رگرسیون بر روی متغیر وابسته موهومی..... ۶۹۱

۱۶-۱- متغیر وابسته موهومی..... ۶۹۱

۱۶-۲- مدل احتمال خطی (LPM)..... ۶۹۲

۱۶-۳- تخمین LPM..... ۶۹۴

۱۶-۴- LPM: مثالی عددی..... ۶۹۸

۱۶-۵- کاربردهایی از مدل LPM..... ۷۰۱

۱۶-۶- مدل‌های آلترناتیو..... ۷۰۶

۱۶-۷- مدل لاجیت..... ۷۰۸

۱۶-۸- تخمین مدل لاجیت..... ۷۱۰

۱۶-۹- مدل لاجیت: مثالی عددی..... ۷۱۳

۱۶-۱۰- مدل لاجیت: مثالهای نمونه..... ۷۱۸

۱۶-۱۱- مدل پروبیت..... ۷۲۰

۱۶-۱۲- مدل پروبیت: مثالی عددی..... ۷۲۵

۱۶-۱۳- مدل پروبیت: مثال نمونه..... ۷۲۶

۱۶-۱۴- خلاصه و نتایج..... ۷۳۱

پی‌نویس..... ۷۳۹

فصل هفدهم..... ۷۴۵

مدلهای خود رگرسیونی و با وقفه توزیعی..... ۷۴۵

۱۷-۱- نقش زمان یا وقفه در اقتصاد ۷۲۶

۱۷-۳- تخمین مدل‌های با وقفه توزیعی ۷۵۲

۱۷-۴- روش کویک در رابطه با مدل‌های با وقفه توزیعی ۷۵۵

۱۷-۵- دلیل در جهت تأیید مدل کویک: مدل انتظارات تطبیقی ۷۵۹

۱۷-۶- دلیلی دیگر در جهت تأیید مدل کویک: مدل تعدیل موجودی یا مدل تعدیل جزئی ۷۶۲

۱۷-۷- تلفیق مدل‌های انتظارات تطبیقی و تعدیل جزئی ۷۶۵

۱۷-۸- تخمین مدل‌های خود رگرسیونی ۷۶۶

۱۷-۹- روش متغیرهای ابزاری (IV) ۷۶۸

۱۷-۱۰- کشف خود همبستگی در مدل‌های خود رگرسیونی ۷۷۰

۱۷-۱۱- مثالی عددی: تقاضای پول در هندوستان ۷۷۲

۱۷-۱۲- مثال‌های نمونه ۷۷۴

۱۷-۱۳- روش آلمون در رابطه با مدل‌های با وقفه توزیعی: وقفه چند ۷۸۰

۱۷-۱۴- علیت در علم اقتصاد: آزمون گرنجر ۷۸۹

۱۷-۱۵- خلاصه نتایج ۷۹۱

تمرینات فصل هفدهم ۷۹۴

پی‌نویس ۸۰۳

بخش چهارم ۸۱۱

مدل‌های معادلات همزمان ۸۱۱

بخش چهارم ۸۱۲

مدل‌های معادلات همزمان ۸۱۲

فصل هجدهم ۸۱۴

مدل‌های معادلات همزمان ۸۱۴

۱۸-۱- ماهیت مدل‌های معادلات همزمان ۸۱۴

۱۸-۱- مثالهایی از مدل‌های معادلات همزمان ۸۱۵

۱۸-۳- تورش معادلات همزمان - ناسازگاری تخمین‌زنهای OLS ۸۲۳

۱۸-۴- تورش معادلات همزمان: یک مثال عددی ۸۲۶

۱۸-۵- خلاصه و نتایج ۸۲۸

تمرینات فصل هجدهم ۸۲۹

پی‌نویس ۸۳۴

فصل نوزدهم ۸۳۷

مسأله تشخیص ۸۳۷

۱-۱۹- تعاریف و نمادها ۸۳۸

۲-۱۹- مسأله تشخیص ۸۴۲

۳-۱۹- قواعد جهت بررسی قابلیت تشخیص یک معادله ۸۵۲

شرط رتبه‌ای در رابطه با قابلیت تشخیص: [۶] ۸۵۶

۴-۱۹- خلاصه و نتایج ۸۶۰

تمرینات فصل نوزدهم ۸۶۱

پی‌نویس ۸۶۴

فصل بیستم ۸۶۵

روشهای معادلات همزمان ۸۶۵

۱-۲۰- روشهای تخمین ۸۶۵

۲-۲۰- مدل‌های عطفی و روش حداقل مربعات معمولی ۸۶۷

۳-۲۰- تخمین یک معادله دقیقاً مشخص ۸۷۰

۵-۲۰- روش 2SLS: یک مثال عددی ۸۸۰

۶-۲۰- مثالهای نمونه ۸۸۲

خلاصه و نتایج ۸۹۲

تمرینات فصل بیستم ۸۹۳

پی‌نویس ۹۰۰

بخش پنجم ۹۰۳

اقتصادسنجی سریهای زمانی ۹۰۳

اقتصادسنجی سریهای زمانی ۹۰۴

فصل بیست و یک ۹۰۷

اقتصادسنجی سریهای زمانی A: ۹۰۷

ایستایی، ریشه‌های واحد و هم‌انباشتگی ۹۰۷

۱-۲۱- بررسی گزیده‌ای از سریهای زمانی اقتصادی ایالات متحده ۹۰۸

۹۰۹	۲۱-۲- فرآیند تصادفی ساکن (ایستا).....
۹۱۳	۲۱-۳- آزمون ساکن بودن براساس نمودار همبستگی.....
۹۱۷	۲۱-۴- آزمون ریشه واحد: آزمونی برای ایستا بودن.....
۹۲۳	۲۱-۵- فرایندهای استوکاستیک.....
۹۲۵	۲۱-۶- رگرسیون ساختگی.....
۹۲۷	۲۱-۷- هم انباشتگی.....
۹۳۰	۲۱-۸- هم انباشتگی و مکانیزم تصحیح خطا (ECM).....
۹۳۱	۲۱-۹- خلاصه و نتیجه گیری.....
۹۳۳	تمرینات فصل بیست و یکم.....
۹۳۵	ضمیمه ۲۱A.....
۹۳۶	پی نویس.....
۹۴۱	فصل بیست و دوم.....
۹۴۱	اقتصادسنجی سری های زمانی I I.....
۹۴۱	پیش بینی با استفاده از مدل های VAR و ARIMA.....
۹۴۲	۱- ۲۲. روش های پیش بینی اقتصادی.....
۹۴۳	۲- ۲۲: مدلسازی MA, AR و ARIMA برای داده های سری زمانی.....
۹۴۷	۳- ۲۲- متدولوژی باکس - جنکینز.....
۹۴۸	۴- ۲۲- تشخیص.....
۹۵۴	۵- ۲۲- تخمین مدل ARIMA.....
۹۵۴	۶- ۲۲- کنترل تشخیصی.....
۹۵۵	۷- ۲۲- پیش بینی.....
۹۵۶	۸- ۲۲- جنبه های دیگری از متدولوژی BJ.....
۹۵۷	۹- ۲۲- خودرگرسیون برداری (VAR).....
۹۶۴	۱۰- ۲۲- خلاصه و نتیجه گیری.....
۹۶۶	تمرینات فصل بیست و دوم.....
۹۶۸	پی نویس.....
۹۷۱	یادآوری برخی مفاهیم آماری.....
۹۷۱	۱- A اپراتورهای جمع و ضرب.....

- ۹۷۳ ۲- A فضای نمونه، عناصر نمونه، و حوادث
- ۹۷۴ ۳- A احتمال و متغیرهای تصادفی
- ۹۷۵ ۴- A تابع چگالی احتمال (PDF) [۲]
- ۹۷۵ تابع چگالی احتمال متغیر تصادفی ناپیوسته:
- ۹۷۶ تابع چگالی احتمال یک متغیر تصادفی پیوسته:
- ۹۷۷ توابع چگالی احتمال مشترک:
- ۹۷۸ توابع چگالی احتمال حاشیه‌ای:
- ۹۸۰ استقلال آماری
- ۹۸۳ ۵- A ویژگیهای توزیعهای احتمال:
- ۹۸۳ امید ریاضی:
- ۹۸۵ ویژگیهای امید ریاضی:
- ۹۸۶ واریانس:
- ۹۸۸ ویژگیهای واریانس:
- ۹۸۸ کوواریانس:
- ۹۸۹ ویژگیهای کوواریانس:
- ۹۹۰ ضریب همبستگی:
- ۹۹۱ میانگین (امید ریاضی) شرطی و واریانس شرطی:
- ۹۹۲ واریانس شرطی:
- ۹۹۳ ۶- A برخی از توزیعهای مهم نظری احتمال:
- ۹۹۶ توزیع χ^2 (چی دو)
- ۹۹۷ ویژگیهای توزیع χ^2 :
- ۹۹۷ توزیع t استیودنت:
- ۹۹۸ توزیع F:
- ۹۹۹ ویژگیهای توزیع F:
- ۱۰۰۰ ۷- A استنتاج آماری تخمین:
- ۱۰۰۰ تخمین نقطه‌ای:
- ۱۰۰۱ تخمین فاصله‌ای:
- ۱۰۰۳ ویژگیهای تخمین‌زنهای نقطه‌ای:
- ۱۰۰۳ ویژگیهای نمونه‌های کوچک:

۱۰۰۷	ویژگیهای نمونه‌های بزرگ:
۱۰۱۱	۸- A استنتاج آماری:
۱۰۱۱	آزمون فرضیه:
۱۰۱۲	روش فاصله اطمینان:
۱۰۱۵	روش آزمون معنی‌دار بودن:
۱۰۱۸	پی‌نویس
۱۰۲۰	منابع
۱۰۲۱	یادآوری مباحثی از جبر ماتریس
۱۰۲۱	۱- B: تعاریف:
۱۰۲۱	ماتریس:
۱۰۲۲	بردار ستونی:
۱۰۲۲	بردار سطری:
۱۰۲۲	ترانسپوز کردن یک ماتریس:
۱۰۲۳	زیرماتریس:
۱۰۲۴	۲- B انواع ماتریس:
۱۰۲۴	ماتریس مربع:
۱۰۲۴	ماتریس قطری:
۱۰۲۴	ماتریس اسکالر:
۱۰۲۵	ماتریس یکه یا واحد:
۱۰۲۵	ماتریس متقارن:
۱۰۲۵	ماتریس صفر:
۱۰۲۵	بردار صفر:
۱۰۲۶	ماتریسهای مساوی:
۱۰۲۶	۳- B عملیات ماتریسی:
۱۰۲۶	جمع ماتریس‌ها:
۱۰۲۷	تفریق ماتریس‌ها:
۱۰۲۷	ضرب اسکالر:
۱۰۲۷	ضرب ماتریس‌ها:
۱۰۲۸	ویژگیهای ضرب ماتریس:

- ویژگیهای ترانسپوز ماتریس: ۱۰۳۰.....
- معکوس (کردن) ماتریس: ۱۰۳۱.....
- ۴- B دترمینان: ۱۰۳۲.....
- تعیین مقدار یک دترمینان: ۱۰۳۲.....
- ویژگیهای دترمینان: ۱۰۳۳.....
- رتبه ماتریس: ۱۰۳۵.....
- ماینور: ۱۰۳۵.....
- کوفاکتور: ۱۰۳۶.....
- ماتریس کوفاکتور: ۱۰۳۶.....
- ماتریس الحاقی: ۱۰۳۷.....
- ۵- B روش محاسبه معکوس یک ماتریس مربع: ۱۰۳۷.....
- ۶- B مشتق‌گیری از ماتریس: ۱۰۳۹.....
- پی‌نویس: ۱۰۴۰.....
- ۷- B: منابع: ۱۰۴۰.....
- لیستی از برخی نرم‌افزارهای آماری کامپیوتری: ۱۰۴۱.....
- ضمیمه D ۱۰۴۵.....
- جداول آماری ۱۰۴۵.....
- ضمیمه D جداول آماری: ۱۰۶۲.....
- منابع و مآخذ انتخابی ۱۰۶۳.....
- رفرانس ۱۰۶۷.....
- «واژه‌نامه» ۱۰۷۱.....
- «واژه‌نامه» ۱۰۸۹.....
- فصل چهاردهم (چاپ چهارم، سال ۲۰۰۳، کتاب اصلی). ۱۱۱۹.....
- مدل‌های رگرسیون غیرخطی. ۱۱۱۹.....
- ۱-۱۴ مدل‌های رگرسیون ذاتاً خطی و ذاتاً غیرخطی. ۱۱۱۹.....
- ۲-۱۴ تخمین مدل‌های رگرسیون خطی و غیرخطی. ۱۱۲۱.....
- ۳-۱۴ تخمین مدل‌های رگرسیون غیرخطی: روش آزمون و خطا. ۱۱۲۲.....
- ۴-۱۴ روش‌های تخمین مدل‌های رگرسیونی غیرخطی. ۱۱۲۵.....
- ۵-۱۴ مثال‌های توضیحی. ۱۱۲۷.....
- ۶-۱۴ خلاصه و نتیجه‌گیری. ۱۱۳۱.....

۱۱۳۲	تمرینات
۱۱۳۲	پرسش‌ها
۱۱۳۳	مسائل
۱۱۳۶	ضمیمه ۱۴A
۱۱۳۶	۱۴A-۱ استخراج معادلات (۱۴-۲-۴) و (۱۴-۲-۵)
۱۱۳۶	۱۴A-۲ روش خطی سازی
۱۱۳۸	۱۴A-۳ تقریب خطی تابع نهایی در (۱۴-۲-۲)
۱۱۴۱	فصل شانزدهم (چاپ چهارم، سال ۲۰۰۳، کتاب اصلی)
۱۱۴۱	مدل‌های رگرسیون با داده‌های تابلویی
۱۱۴۲	۱۶-۱ مزایای استفاده از داده‌های تابلویی
۱۱۴۴	۱۶-۲ داده‌های تابلویی: یک مثال توضیحی
۱۱۴۷	۱۶-۳ تخمین مدل‌های رگرسیون با داده‌های پانل: روش اثرهای ثابت
۱۱۵۵	۱۶-۴ تخمین مدل‌های رگرسیون با داده‌های ترکیبی
۱۱۵۹	۱۶-۵ مدل تأثیرات ثابت (LSDV) در مقایسه با مدل تأثیرات تصادفی
۱۱۶۱	۱۶-۶ رگرسیون با داده‌های تابلویی: چند نتیجه‌گیری
۱۱۶۲	۱۶-۷ خلاصه و نتیجه‌گیری
۱۱۶۳	تمرینات
۱۱۶۳	پرسش‌ها
۱۱۶۵	مسائل