

فهرست مطالب

مقدمه نویسنده کتاب.....	۱۳
فصل اول: مقدمه.....	۱۷
۱-۱ پانل دیتا : شرح چندین مثال.....	۱۸
۱-۱-۱ مثالهایی از پانل دیتای خرد.....	۱۹
۲-۱-۱ مثالهایی از پانل دیتای کلان.....	۲۵
۳-۱-۱ چندین منابع اصلی.....	۲۶
۲-۱ مزیتها و محدودیت های استفاده از پانل دیتا.....	۲۹
فصل دوم: مدل رگرسیون جزء خطا یک طرفه.....	۳۹
۱-۲ مقدمه.....	۴۰
۲-۲ مدل اثرات ثابت.....	۴۲
۳-۲ مدل اثرات تصادفی.....	۴۹
۱-۳-۲ اثرات ثابت در مقابل تصادفی.....	۵۹
۴-۲ برآورد حداکثر راست نمایی.....	۶۰
۵-۲ پیش بینی.....	۶۲
۶-۲ مثالها.....	۶۴
۲۶.۱ مثال ۱ : معادله سرمایه گذاری گرانفلد.....	۶۴
۲۶.۲ مثال ۲ : تقاضای گازویل.....	۶۹
۲۶.۳ مثال ۳ . تولید سرمایه عمومی.....	۷۱

۷۷	موارد کاربردی منتخب
۷۸	نکات قابل توجه محاسباتی
۸۰	مسائل
۸۵	فصل سوم: مدل رگرسیون جز خطای دو طرفه
۸۶	۱.۳ مقدمه
۸۷	۲.۳ مدل اثرات ثابت
۸۹	۱.۲.۳ آزمون اثرات ثابت
۹۰	۳.۳ مدل اثرات تصادفی
۹۹	۱.۳.۳ طراحی یک مثال
۱۰۱	۴.۳ تخمین حداکثر راستمایی
۱۰۵	۵.۳ پیش بینی
۱۰۸	۶.۳ مثالها
۱۰۸	۱۶.۳ مثال ۱: معادله سرمایه گذاری گارنفلد
۱۱۴	۲۶.۳ مثال ۲: تقاضای گازوئیل
۱۱۵	۳۶.۳ مثال ۳: بهره وری سرمایه عمومی
۱۱۷	۷.۳ کاربردهای منتخب
۱۱۸	مسائل
۱۲۹	فصل چهارم: آزمون فرضیه‌ها در پانل دیتا
۱۳۰	۱.۴ آزمونهای یکسان سازی داده‌ها
۱۳۱	۱.۱.۴ آزمون یکسان سازی به صورت $u \sim N(0, 6^2 I_{NT})$
۱۳۳	۲.۱.۴ آزمون یکسان سازی تحت فرض عمومی $U \sim N(0, \Omega)$
۱۳۷	۳.۱.۴ مثالها
۱۳۹	۴.۱.۴ سایر آزمون‌ها برای سنجش یکسان سازی

۲.۴	آزمون‌های اثرات زمان و متغیرها.....	۱۴۱
۱.۲.۴	آزمون بروش - پاگان.....	۱۴۱
۲.۲.۴	کینگ، وو، هوندا و آزمون های استاندارد شده ضریب لاگرانژ.....	۱۴۴
۳.۲.۴	آزمون گوربروکس، هالی و مونفورت.....	۱۴۶
۴.۲.۴	آزمون ضریب لاگرانژین شرطی.....	۱۴۷
۵.۲.۴	ANOVA F و آزمون نرخ راستمایی.....	۱۴۸
۶.۲.۴	نتایج مونت کارلو.....	۱۴۹
۷.۲.۴	نمونه شهودی.....	۱۵۱
۳.۴	آزمون تصریح هاسمن.....	۱۵۶
۱.۳.۴	مثال ۱.....	۱۶۴
۲.۳.۴	مثال ۲.....	۱۶۷
۳.۳.۴	مثال ۳.....	۱۶۸
۴.۳.۴	مثال ۴.....	۱۶۹
۵.۳.۴	مثال ۵.....	۱۶۹
۶.۳.۴	مثال ۶.....	۱۶۹
۷.۳.۴	آزمون هاسمن در مدل دوطرفه.....	۱۷۰
۴.۴	مطالعات بیشتر.....	۱۷۳
	مسائل.....	۱۷۵
	فصل پنجم: واریانس ناهمسانی و همبستگی سریالی در مدل جز خطا.....	۱۸۱
۱.۵	واریانس ناهمسانی.....	۱۸۲
۱.۱.۵	آزمون واریانس ناهمسانی در مدل جزء خطا.....	۱۸۸
۲.۵	همبستگی سریالی.....	۱۹۰
۱.۲.۵	فرآیند خودرگرسیون مرتبه اول ($AR(1)$).....	۱۹۱

۲.۲.۵	فرآیند خودرگرسیون مرتبه دوم ($AR(2)$)	۱۹۶
۳.۲.۵	فرآیند خودرگرسیون مرتبه چهارم ($AR(4)$) برای داده‌های فصلی	۱۹۸
۴.۲.۵	فرآیند میانگین متحرک مرتبه اول ($MA(1)$)	۱۹۸
۵.۲.۵	پانل‌های نابرابر با جز خطای خودرگرسیو از مرتبه اول	۲۰۲
۶.۲.۵	پیش بینی	۲۰۵
۷.۲.۵	آزمونی برای همبستگی سریالی و اثرات منفرد	۲۰۸
۸.۲.۵	مطالعات دیگر	۲۲۵
مسائل		۲۲۷
فصل ششم: رگرسیون‌های به ظاهر نامرتبط با جزء خطا		۲۳۳
۱۶ مدل‌های یک طرفه		۲۳۴
۲۶ مدل‌های دو طرفه		۲۳۶
۳۶ کاربردها و توسعه بحث		۲۳۸
مسائل		۲۴۱
فصل هفتم: معادلات همزمان با جز خطا		۲۴۳
۱.۷ تخمین تک معادله		۲۴۴
۲.۷ مثال تجربی: جرم در کارولینای شمالی		۲۵۰
۳.۷ برآورد سیستم		۲۵۱
۴.۷ برآوردگر تیلور و هاسمن		۲۶۳
۵.۷ مثال تجربی: معادله درآمد با استفاده از پانل دیتا		۲۶۹
۶.۷ مطالعات بیشتر و بسط مطلب		۲۷۵
مسائل		۲۷۹
فصل هشتم: مدل‌های پانل دیتای پویا		۲۸۷
۱.۸ مقدمه		۲۸۸

۲۹۱	تخمین زن آرلانو و باند
۲۹۳	۱.۲.۸ آزمون اثرات منفرد در مدل های خودرگرسیون
۲۹۵	۲.۲.۸ مدل های با متغیرهای برونزا
۳۰۰	۳.۸ تخمین زن آرلانو و باور
۳۰۵	۴.۸ شرایط گشتاوری آن و اشمیت
۳۰۹	۵.۸ تخمین زن گشتاور تعمیم یافته بلاندل و باند
۳۱۲	۶.۸ تخمین زن کین و رانکل
۳۱۵	۷.۸ توسعه بحث
۳۳۶	۸.۸ مثالهای تجربی
۳۳۶	۱.۸.۸ مثال ۱: تقاضای پویا برای سیگار
۳۳۱	۲.۸.۸ مثال ۲: دموکراسی و آموزش
۳۳۴	۹.۸ مطالعات بیشتر
۳۴۰	مسائل
۳۴۳	فصل نهم: مدل های پانل دیتای نامتوازن
۳۴۴	۱.۹ مقدمه
۳۴۵	۲.۹ مدل جزء خطای یک طرفه نامتوازن
۳۴۸	۱.۲.۹ روش ANOVA
۳۵۱	۲.۲.۹ تخمین زننده های حداکثر راستنمایی
۳۵۲	۳.۲.۹ قاعده حداقل ارزش و تخمین زننده بدون تورش درجه دوم حداقل واریانس
۳۵۳	۴.۲.۹ نتایج مونت کارلو
۳۵۴	۳.۹ نمونه تجربی: مسکن سازی هدانیک
۳۵۹	۴.۹ مدل جزء خطای دوطرفه نامتوازن
۳۶۰	۱.۴.۹ مدل اثرات ثابت

۳۶۱.....	۲.۴.۹ مدل اثرات تصادفی.....
۳۶۳.....	۵.۹ آزمون اثرات منفرد و زمانی با استفاده از پانل نامتوازن.....
۳۶۸.....	۶.۹ مدل جزء خطای نامتوازن پیچیده.....
۳۶۹.....	۱۶.۹ نمونه تجربی.....
۳۷۴.....	مسائل.....
۳۷۹.....	فصل دهم: عناوین ویژه.....
۳۸۰.....	۱.۱۰ خطای اندازه گیری و پانل دیتا.....
۳۸۶.....	۲.۱۰ پانل های چرخشی.....
۳۸۹.....	۳.۱۰ پانل های غیر واقعی.....
۳۹۵.....	۴.۱۰ روش های جایگزینی سری های زمانی یکسان شده.....
۳۹۸.....	۵.۱۰ پانلهای فضایی.....
۴۰۴.....	۶.۱۰ برآورد کوتاه مدت و بلندمدت مدل های یکسان شده.....
۴۰۶.....	۷.۱۰ پانل های ناهمگن.....
۴۱۵.....	۸.۱۰ پانل دیتا شمارشی.....
۴۲۷.....	مسائل.....
۴۳۳.....	فصل یازدهم: پانل دیتا و متغیرهای وابسته محدود.....
۴۳۵.....	۱.۱۱ مدل های اثرات ثابت و تصادفی لاجیت و پروبیت.....
۴۴۶.....	۲.۱۱ شبیه سازی برآورد مدل متغیر وابسته محدود در پانل دیتا.....
۴۴۹.....	۳.۱۱ مدل های متغیر وابسته محدود پانل دیتای پویا.....
۴۵۶.....	۴.۱۱ انتخاب تورش در پانل دیتا.....
۴۶۵.....	۵.۱۱ مدل های پانل با داده های سانسور شده.....
۴۷۱.....	۶.۱۱ کاربردهای تجربی.....
۴۷۴.....	۷.۱۱ نمونه تجربی: عرضه نیروی کار پرستاران.....

۳۷۹.....	۸.۱۱ مطالعات بیشتر
۴۸۴.....	مسائل
۴۸۹.....	فصل دوازدهم: پانل‌های نامانا
۴۹۰.....	۱.۱۲ مقدمه
۴۹۳.....	۲.۱۲ آزمون‌های ریشه واحد با فرض استقلال بین بخشی
۴۹۴.....	۱.۲.۱۲ آزمون لوین، لین و چی
۴۹۸.....	۲.۲.۱۲ آزمون ایم، پسران و شین
۵۰۱.....	۳.۲.۱۲ آزمون بریتینگ
۵۰۲.....	۴.۲.۱۲ ترکیب آزمونهای p-value
۵۰۵.....	۵.۲.۱۲ آزمون ضریب لاگرانژ مبتنی بر جز پسماند
۵۰۸.....	۳.۱۲ آزمون‌های ریشه واحد دارای متغیر وابسته مقطعی
۵۱۶.....	۴.۱۲ رگرسیون ساختگی در پانل دیتا
۵۱۹.....	۵.۱۲ آزمونهای هم انباشتگی پانل
۵۱۹.....	۱.۵.۱۲ آزمون DF, ADF مبتنی بر پسماند (آزمونهای کاو)
۵۲۱.....	۲.۵.۱۲ آزمون ضریب لاگرانژ مبتنی بر جزء پسماند
۵۲۳.....	۳.۵.۱۲ آزمون‌های پدرونی
۵۲۴.....	۴.۵.۱۲ آزمون هم انباشتگی راستنمایی
۵۲۵.....	۵.۵.۱۲ ویژگی نمونه محدود
۵۲۷.....	۶.۱۲ تخمین و تفسیر در مدل‌های هم انباشتگی پانل
۵۳۲.....	۷.۱۲ نمونه تجربی: برابری قدرت خرید
۵۳۵.....	۸.۱۲ مطالعات دیگر
۵۴۲.....	مسائل
۵۴۶.....	فهرست منابع