

فهرست و عناوین

پیشگفتار	۵
مقدمه	۱۱
نرم افزار Eviews (Econometric Views)	۱۲

فصل اول:

مفاهیم پایه‌ای از مدل‌های اقتصادسنجی

مقدمه	۱۵
اقتصاد و مدل‌های اقتصادسنجی	۱۵
داده اقتصادی	۱۶
ساختن فایل اولیه کاری در نرم افزار	۱۷
متغیرهای مدل اقتصادی	۱۹
پارامترها و کشش‌ها	۲۰
فرض‌های معین	۲۰
تحلیل و ارزیابی نتایج تخمین	۲۰

فصل دوم:

توصیف مجموعه داده‌ها و معرفی مورد به مورد

مقدمه	۲۵
انواع آیکون‌های نرم افزار	۳۱
عملیات‌های موضوعی اصلی	۳۲
برخی از محاسبات اصلی در Eviews	۵۶
برآوردگرهای حداقل مربعات معمولی (OLS)	۵۹
انجام رگرسیون با اکسل	۷۴

فصل سوم:

آزمون ضرایب

۷۹	 مقدمه
۷۹	 آزمون های برقراری فروض مدل
۷۹	 آزمون های آماری مقید سازی

فصل چهارم:

آزمون های فروض و ثبات مدل

۸۹	 مقدمه
۸۹	 آزمون برقراری فروض کلاسیک
۹۶	 آزمون خودهمبستگی پسماند
۱۰۷	 آزمون های واریانس ناهمسانی
۱۱۴	 آزمون هم خطی
۱۱۷	 آزمون ثبات پارامترها

فصل پنجم:

مدلسازی نوسانات

۱۲۷	 مقدمه
۱۲۷	 مدل ARCH
۱۳۰	 مدل ARCH (1)
۱۳۱	 مدل GARCH
۱۳۱	 تخمین مدل های ARCH
۱۳۲	 مدل TARCH
۱۳۳	 مدل EGARCH
۱۳۳	 برازش مدل های نوسانی در نرم افزار Eviews
۱۴۷	 مدل TARCH

فصل ششم:

مدل‌های حداقل مربعات معمولی پویا DOLS

۱۵۷.....	مقدمه
۱۵۸.....	برآورد حداقل مربعات معمولی پویا
۱۶۱.....	برآزش مدل در نرم افزار

فصل هفتم:

مدل‌های سری زمانی

۱۷۷.....	مقدمه
۱۷۷.....	آزمون ریشه واحد دیکی - فولر
۱۹۳.....	مدل‌های میانگین متحرک
۲۰۵.....	مدل‌های فصلی ARIMA
۲۲۵.....	علیت گرنجری
۲۳۰.....	سیستم معادلات همزمان 2SLS
۲۳۸.....	2SLS در نرم افزار Eviews

فصل هشتم:

روش گشتاورهای تعمیم یافته GMM

۲۴۵.....	مقدمه
۲۴۵.....	روش گشتاورها
۲۴۷.....	تخمین روش تعمیم یافته گشتاورها

فصل نهم:

مدل‌های LPM, Logit, Probit

۲۵۹.....	مقدمه
۲۶۳.....	مدل احتمال خطی LPM
۲۶۵.....	مدل لاجیت Logit
۲۶۷.....	مدل پروبیت Probit

فصل دهم:

مدل خودرگرسیون برداری و روش تصحیح خطا (VAR and ECM)

مقدمه	۲۷۳
مدل خودرگرسیون برداری	۲۷۳
مدل تصحیح خطا برداری VECM	۲۹۱

فصل یازدهم:

مدل ARDL

مقدمه	۳۰۹
ویژگی های روش خودرهمبسته با وقفه های توزیعی	۳۰۹

منابع	۳۳۹
-------	-----