

القياس الإقتصادي

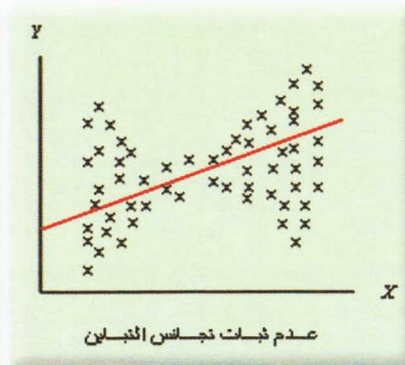
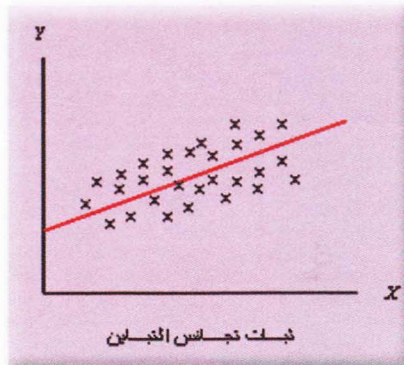
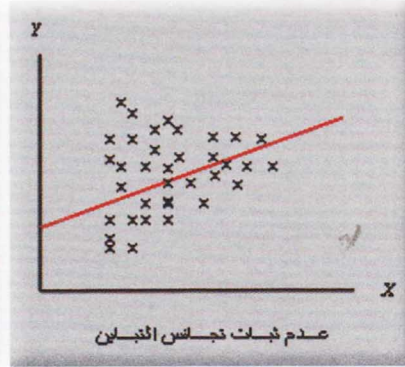
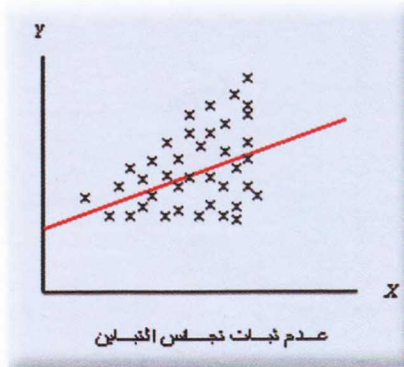
النظرية والتحليل

ECONOMETRICS

Theories & Analyze

الأستاذ المساعد الدكتور
حسن لطيف الزبيدي

الأستاذ الدكتور
كامل علاوي كاظم الفتلاوي





الفهرس

المقدمة 13

القسم الأول

الفصل الأول: نطاق القياس الاقتصادي

19	خلفية تاريخية
21	مفهوم القياس الاقتصادي
22	أهداف القياس الاقتصادي
23	علاقة القياس الاقتصادي بالعلوم الأخرى
24	أقسام القياس الاقتصادي
24	الاقتصاد القياسي والحاسوب

الفصل الثاني: طبيعة القياس الاقتصادي

27	العلاقات بين المتغيرات الاقتصادية
28	النموذج الاقتصادي
28	النموذج الرياضي والنموذج القياسي
29	مراحل بناء النموذج الاقتصادي
29	المرحلة الأولى: توصيف وصياغة النموذج
30	المرحلة الثانية: تقدير النموذج المصاغ
30	المرحلة الثالثة: اختبار النموذج المقدر
31	المرحلة الرابعة: التنبؤ



القسم الثاني

الفصل الثالث: نموذج الانحدار الخطي ذي المتغيرين

41	فروض المتغير العشوائي
44	خواص المتغير التابع
45	تقدير معلمات نموذج الانحدار الخطي البسيط
48	أولاً: التقدير حول نقطة الأصل
58	ثانياً: استخدام المصفوفات في تقدير معلمات الانحدار
62	ثالثاً: التقدير حول نقطة المتوسط
67	خصائص مقدرات المربعات الصغرى
67	1. الخطية Linearity
68	2. خاصية عدم التحيز Unbiasedness
70	3. خاصية الأفضلية Best
72	تباين الخطأ العشوائي (U_i)
75	خصائص أوزان مقدرات المربعات الصغرى باستخدام الانحرافات
77	خصائص مقدرات المربعات الصغرى باستخدام المصفوفات
79	اختبار الفروض Hypothesis Test
83	حدود الثقة لمعلمات الانحدار
86	معامل التحديد (Determinant Coefficient)
89	العلاقة بين معامل الارتباط ومعامل التحديد
91	اختبار F
92	تكوين قاعدة القرار
93	العلاقة بين اختبار (t و F)
94	التقدير بموجب أعظم احتمال



الفصل الرابع: نموذج الانحدار الخطي المتعدد

102	طرق تقدير نموذج الانحدار الخطي المتعدد
106	التقدير باستخدام طريقة المصفوفات
107	التقدير حول نقطة المتوسط (استخدام الانحرافات)
112	تحليل الانحرافات في حالة الانحدار الخطي المتعدد
115	اختبار الفروض Hypothesis Test
117	اختبار معنوية المعلمات المقدرة

الفصل الخامس: الانحدار وتحليل التباين

123	استخدام تحليل التباين في اختبار المعنوية الكلية للانحدار
126	استخدام تحليل التباين في اختبار التحسن في جودة الانحدار
131	اختبار التساوي بين المعاملات التي يتم الحصول عليها من عينات مختلفة
133	استخدام تحليل التباين في اختبار ثبات معاملات الانحدار عند زيادة حجم العينة
136	اختبار القيود المفروضة على معلمات الدالة

القسم الثالث

الفصل السادس: مشكلة الارتباط الذاتي

145	تحليل مشكلة الارتباط الذاتي
146	أسباب مشكلة الارتباط الذاتي
147	أثار وجود مشكلة الارتباط الذاتي
148	اختبارات الكشف عن الارتباط الذاتي
148	الطريقة الأولى: طريقة التكرار
149	الطريقة الثانية: اختبار دوربين - واتسون

152	 معالجة مشكلة الارتباط الذاتي
152	 أولاً: طريقة التكرار (Iterative Method)
155	 ثانياً: طريقة دوربين (Durbin's Method)
156	 الارتباط الذاتي من الدرجات العليا

الفصل السابع: مشكلة الارتباط الخطي المتعدد

169	 اختبار مشكلة الارتباط الخطي المتعدد
169	 اختبار فارار - كلوبر Farrar- Gluabbr
173	 اختبار كلاين Klein
175	 حلول مشكلة الارتباط الخطي المتعدد

الفصل الثامن: مشكلة عدم ثبات تجانس التباين

182	 طريقة المربعات الصغرى المعممة (Generalized Lest Square - GLS)
190	 طرق اختبار مشكلة عدم ثبات تجانس التباين
190	 أولاً: اختبار Gold-Feld & Quandt
193	 ثانياً: اختبار بارتليت Bartlett Test
197	 ثالثاً: اختبار معامل ارتباط الرتب لسبيرمان

الفصل التاسع: المتغيرات المتأخرة زمنياً

206	 (أ) نموذج كويك Koyck Model
211	 (ب) نموذج نيرلوف للتعديل الجزئي
213	 (ج) نموذج التوقعات المكيفة
215	 تقدير النماذج المتأخرة زمنياً

الفصل العاشر: المعادلات الآنية

222	 نموذج الطلب على الغذاء
223	 مشاكل المعادلات الآنية
223	 مشكلة التحيز الآني (Simultaneous Equations Bias)
225	 مشكلة التشخيص (Identification Problem)
226	 طبيعة مشكلة التشخيص

الفصل الحادي عشر: طرق تقدير المعادلات الآنية

233	 طريقة المربعات الصغرى غير المباشرة (ILS)
237	 طريقة المربعات الصغرى ذات المرحلتين (2SLS)

الفصل الثاني عشر: المتغيرات الوهمية

249	 المتغيرات الوهمية
-----	-------------------------

الفصل الثالث عشر: تحليل دالة الإنتاج

261	 تحليل دالة الإنتاج
-----	--------------------------

الفصل الرابع عشر: تحليل السببية

269	 تحليل السببية
277	 الجداول الإحصائية
287	 مراجع الكتاب