

طرق القياس الاقتصادي

الأستاذ الدكتور

أموري هادي كاظم الحسناوي

أستاذ الإحصاء والقياس الاقتصادي



الفهرس

Contents

المحتويات

vii-ix	المحتويات
1-5	مقدمة عامة

الفصل الأول : طبيعة القياس الاقتصادي والنموذج الخطي البسيط (SLM) 7-68

7	1.1 تعريف القياس الاقتصادي
9	1.2 خصائص البحث القياسي
10	1.3 فروض المربعات الصغرى الاعتيادية
15	1.4 تقديرات المربعات الصغرى الاعتيادية
21	1.5 استدلال في تحليل الانحدار البسيط
27	1.6 تقدير معالم النموذج بطريقة دالة الامكان الاعظم
39	1.7 تحليل انحرافات المتغير المعتمد في النموذج الخطي البسيط
43	1.8 قياس فترات الثقة
53	1.9 تحليل دوال الطلب
68	تمارين

الفصل الثاني: النموذج الخطي العام (GLM) 71-136

71	2.1 التقدير حول نقطة الأصل
73	2.2 تقديرات (OLS) في حالة الـ (GLM)
81	2.3 التقدير حول نقطة المتوسط
88	2.4 مقدرات الإمكان الأعظم في حالة النموذج الخطي العام
92	2.5 تحليل الانحرافات في حالة النموذج الخطي المتعدد
110	2.6 استدلال في تحليل الانحدار العام
120	2.7 تحليل دوال الإنتاج
136	تمارين

الفصل الثالث : المربعات الصغرى الموزونة (WLS) ومشكلة عدم التجانس 141-201

- 3.1 المقدمة 141
- 3.2 مشكلة عدم تجانس التباين 142
- 3.3 تقديرات المربعات الصغرى الموزونة 150
- 3.4 مقارنة بين طريقة (OLS) و (WLS) - كفاءة التقدير 156
- 3.5 اختبار عدم تجانس تباين الخطأ 171
- 3.6 معالجة مشكلة عدم تجانس التباين 181
- 3.7 جدول تحليل التباين (ANOVA) 195
- تمارين 201

الفصل الرابع : المربعات الصغرى العامة ومشكلة الارتباط الذاتي 203-252

- 4.1 المقدمة 203
- 4.2 الارتباط الذاتي من الدرجة الاولى 204
- 4.3 تقديرات المربعات الصغرى العامة 210
- 4.4 مقارنة بين طريقتي (OLS) و (GLS) كفاءة التقدير 213
- 4.5 طرق تقدير قيمة الارتباط الذاتي (ρ) 230
- 4.6 اختبار وجود الارتباط الذاتي 233
- 4.7 جدول تحليل التباين (ANOVA) 249
- تمارين 252

الفصل الخامس : المربعات الصغرى المقيدة ومشكلة التعدد الخطي 257-298

- 5.1 المقدمة 257
- 5.2 آثار مشكلة التعدد الخطي 258
- 5.3 اختبار وجود مشكلة التعدد الخطي 261
- 5.4 معالجة مشكلة التعدد الخطي 271
- 5.5 تقديرات المربعات الصغرى المقيدة (RLS) 279
- 5.6 مقارنة بين طريقة (RLS) و (OLS) - كفاءة التقدير 285

Contents

المحتويات

286	5.7 جدول تحليل التباين (ANOVA)
295	تمارين

299-366 الفصل السادس : منظومة المعادلات الآنية

299	6.1 المقدمة
300	6.2 فروض منظومة المعادلات الآنية
305	6.3 التشخيص والاختزال
312	6.4 الشروط الأساسية للتشخيص
322	6.5 الصيغة العامة للتشخيص والاختزال
339	6.6 طريقة المربعات الصغرى غير المباشرة (ILS)
352	6.7 طريقة المربعات الصغرى ذات المرحلتين (2SLS)
355	6.8 طريقة المتغيرات المساعدة (IV)
366	تمارين

367-420 الفصل السابع : التنبؤات

367	7.1 المقدمة
368	7.2 التنبؤ باستخدام تحليل الانحدار
396	7.3 التنبؤ باستخدام تحليل السلاسل الزمنية
400	7.4 التنبؤ بطريقة الأوساط المتحركة
408	7.5 التنبؤ بطريقة التمهيد الأسّي
415	7.6 التنبؤ بطريقة بوكس - جينكز
420	تمارين

423 الجداول الاحصائية

429 المصادر