الاقتصاد القياسي

الأستاذ الدكتور حسين علي بخيت

الدكتورة سحر فتح الله

اليازوري
www.yazori.com

المحتـــويات

المحتويات		13-7
تمهيد		16-15
الفصل الاول: المقدمة.		33-17
	1.1 تعريف الاقتصاد القياسي.	18
	2.1 أهداف الاقتصاد القياسي.	19
	3.1 علاقة الاقتصاد القياسي بالعلوم الأخرى.	20
	4.1 النموذج الاقتصادي.	22
	5.1 أنواع النماذج.	25
	6.1 مكونات النموذج.	26
	7.1 منهجية الاقتصاد القياسي.	27
	8.1 أسلوب الاقتصاد القياسي.	31
	9.1 الأسئلة والتمارين.	33
الفصل الثاني: الانحدار الخطي البسيط، Simple Linear Regression		78-34
	1.2 المقدمة.	36
	2.2 الفرضيات الخاصة بالمتغير العشوائي.	38
	3.2 طريقة المربعات الصغرى، OLS.	41
	1.3.2 طرق تقدير معاملات النموذج:	45
	1.1.3.2 طريقة الحذف والتعويض	46
	2.1.3.2 طريقة المحددات.	47
	3.1.3.2 طريقة التقدير حول نقطة المتوسط.	50

	4.1.3.2 طريقة المصفوفات.	53
	2.3.2 الخواص الأساسية لمقدرات المربعات الصغرى.	59
	1.2.3.2 الخاصية الخطية.	59
	2.2.3.2 خاصية عدم التحيز.	64
	3.2.3.2 خاصية أفضل مقدر.	67
	4.2 تقدير تباين حد الخطأ العشوائي.	74
	5.2 الأسئلة والتمارين.	78
الفصل الثالث: اختبار الفرضيات، Hypotheses Testing.		**132-80**
	1.3 المقدمة.	81
	2.3 اختبار قيمة t، t-Value Test.	82
	3.3 معامل التحديد، R^2، Determinant Coefficient.	87
	4.3 اختبار إحصائية F، F-Statistics.	91
	5.3 معامل الارتباط البسيط، r، Simple Correlation Coefficient.	96
	6.3 حدود الثقة لمعاملات الانحدار.	104
	7.3 التنبؤ.	108
	8.3 الأسئلة والتمارين.	127
الفصل الرابع: الانحدار الخطي المتعدد، Multiple Linear Regression		**186-133**
	1.4 المقدمة.	134
	2.4 النموذج الخطي المتعدد.	135
	3.4 فرضيات النموذج الخطي المتعدد.	136
	4.4 طرق تقدير معلمات النموذج.	139
	1.4.4 طريقة المحددات	142

	2.4.4 طريقة الانحرافات.	144
	5.4 التباين والخطأ المعياري لمقدرات OLS.	155
	6.4 اختبار فرضيات النموذج الخطي المتعدد.	161
	1.6.4 اختبار معنوية المعالم (t).	161
	2.6.4 معامل التحديد المتعدد، R^2.	164
	3.6.4 اختبار إحصائية F.	168
	7.4 تحليل جدول التباين، ANOVA.	171
	8.4 قياس حدود الثقة.	179
	9.4 الأسئلة والتمارين.	182
الفصل الخامس: مشكلة الارتباط الذاتي، The Autocorrelation Problem		227-187
	1.5 المقدمة.	188
	2.5 مسببات الارتباط الذاتي.	189
	3.5 تحليل الارتباط الذاتي.	190
	4.5 تقدير معامل الارتباط الذاتي.	195
	1.4.5 طريقة اختبار إحصائية D-W.	195
	2.4.5 طريقة THEIL-NAGAR.	196
	3.4.5 طريقة COHRANE-ORCUTT.	196
	4.4.5 طريقة DURBIN.	197
	5.5 النتائج المترتبة على وجود الارتباط الذاتي.	198
	6.5 اختبار وجود الارتباط الذاتي.	198
	7.5 معالجة مشكلة الارتباط الذاتي.	201
	1.7.5 طريقة التحويل، Transformation Method.	202

204	2.7.5 طريقة التكرار، Iterative Method.	
206	3.7.5 طريقة الفرق العام، The Generalized Difference Method.	
207	4.7.5 طريقة الفرق الأول، The First Difference Method.	
225	8.5 الأسئلة والتمارين.	
256-228	الفصل السادس: مشكلة التعدد الخطي، The Multicollinearity Problem	
229	1.6 المقدمة.	
230	2.6 طبيعة التعدد الخطي.	
231	3.6 أسباب حدوث ظاهرة التعدد الخطي.	
232	4.6 أنواع التعدد الخطي:	
232	1.4.6 غياب التعدد الخطي، Absence of Multicollinearity.	
233	2.4.6 التعدد الخطي التام، Exact Multicollinearity.	
234	3.4.6 التعدد الخطي غير التام، No Exact Multicollinearity	
236	5.6 النتائج المترتبة على وجود التعدد الخطي.	
237	6.6 طرق اختبار وجود التعدد الخطي:	
237	1.6.6 اختبار Firsch.	
244	2.6.6 طريقة FARRAR-GLAUBER.	
244	1.2.6.6 اختبار مربع كاي، χ^2.	
248	2.2.6.6 اختبار إحصاءه F.	
249	3.2.6.6 اختبار إحصاءه t.	
250	3.6.6 اختبار كلاين.	

	7.6 طرق معالجة مشكلة التعدد الخطي.	251
	8.6 الأسئلة والتمارين.	253
	الفصل السابع: مشكلة عدم تجانس تباين المتغير العشوائي، The Heteroscedasticity Problem	286-257
	1.7 المقدمة.	256
	2.7 طبيعة مشكلة عدم تجانس حد الخطأ.	258
	3.7 أسباب عدم تجانس حد الخطأ.	263
	4.7 اكتشاف عدم تجانس حد الخطأ.	264
	1.4.7 أختبار كولدفيلد وكوانت.	264
	2.4.7 اختبار معامل ارتباط الرتب لسبيرمان.	269
	3.4.7 أختبار بارتليت.	274
	4.4.7 طريقة كليجسر.	277
	5.4.7 اختبار بارك.	277
	5.7 معالجة مشكلة عدم تجانس التباين.	279
	6.7 الأسئلة والتمارين	282
	الفصل الثامن: نماذج المعادلات الآنية، Simultaneous Equations Models	335-287
	1.8 طبيعة المعادلات الآنية.	286
	2.8 مشكلة التحيز الآني.	288
	3.8 نماذج المعادلات الآنية في النظرية الاقتصادية.	291
	1.3.8 نموذج العرض والطلب.	291
	2.3.8 النموذج الكينزي لتحديد الدخل القومي.	297
	3.3.8 نموذج فيلبس الأجر النقدي–السعر.	300
	4.8 الشكل المختزل.	301

	5.8 تقدير نموذج المعادلات الآنية.	312
	1.5.8 طريقة المربعات الصغرى غير المباشرة، ILS.	312
	2.5.8 طريقة المتغير الاداتي، IV.	316
	3.5.8 طريقة المربعات الصغرى ذات المرحلتين، TSLS.	323
	6.8 الأسـئلة والتماريـن.	329
الفصل التاسع: مشكلة التشخيص، Identification Problem		351-336
	1.9 المقدمـة.	335
	2.9 طبيعة مشكلة التشخيص.	337
	3.9 شـروط التشـخيـص.	339
	4.9 الأسئلة والتماريـن.	348
الفصل العاشر: المتغيرات المرتدة زمنياً، The Lagged Variables		376-352
	1.10 المقدمة.	351
	2.10 مفهوم النموذج المرتد زمنياً.	351
	3.10 أسباب وجود الارتداد الزمني.	354
	4.10 تقدير النموذج المرتد زمنياً:	355
	1.4.10 نموذج كويك، KOYCH.	355
	2.4.10 نموذج التوقع لـ CAGAN.	359
	3.4.10 نموذج التعديل الجزئي لـ نيرلوف، NERLOV	366
	4.4.10 نموذج الارتداد الزمني متعدد الحدود لـ ألمون، ALMON	370
	5.10 الأسئلة والتمارين.	372
الفصل الحادي عشر: المتغيرات الوهمية، Dummy Variables		402-377
	1.11 المقدمة.	376

	2.11 نموذج الانحدار المتضمن متغير وهمي مستقل واحد.	377
	3.11 نموذج الانحدار المتضمن أكثر من متغير وهمي مستقل.	383
	4.11 نموذج الانحدار المتضمن متغير وهمي تابع.	389
	5.11 الأسئلة والتمارين.	396
المصادر.		409-403
	أولاً: المصادر العربية.	400
	ثانياً: المصادر الانكليزية.	402
الملاحق.		440-410