

فهرست مطالب

فصل اول: مقدمه

فصل دوم: الگوهای سری زمانی

- ۱-۲ فرایند خود توضیح مرتبه اول
- الگوی گام تصادفی
 - ۲-۲ فرایند خود توضیح مرتبه دوم و بیشتر
 - ۳-۲ فرایند میانگین متحرک
 - ۴-۲ فرایند خود توضیح میانگین متحرک
 - ۵-۲ فرایند خود توضیح جمعی میانگین متحرک
 - ۶-۲ فرایند خود توضیح برداری
- پیوست: روندهای قطعی و تصادفی

فصل سوم:

- ۱-۳ آزمون پایانی براساس همبستگی نگار
 - ۲-۳ آزمون ریشه واحد برای پایانی
 - الف - آزمون دیکی - فولر
 - ب - آزمون دیکی - فولر تعمیم یافته
 - ج - آزمون فیلیپس و پرون
- پیوست:

فصل چهارم: آزمون ریشه واحد و شکست ساختاری

- ۱-۴ تغییر در عرض از مبدا تابع روند
 - ۲-۴ تغییر در شیب تابع روند
 - ۳-۴ تغییر در عرض از مبدا و شیب تابع روند
- پیوست: بررسی ناپایانی سری زمانی سطح عمومی قیمتها

فصل پنجم: همجمعی

- ۱-۵ مفهوم اقتصادی و تعریف همجمعی
- ۲-۵ آزمون انگل - گرینجر

۳-۵ آزمون دوربین - واتسون رگرسیون همجمعی

پیوست :

فصل ششم: الگوهای پویا و الگوی تصحیح خطا

۱-۶ الگوهای پویا

۲-۶ الگوی تصحیح خطا

پیوست :

فصل هفتم: همجمعی و الگوهای چندمعادله‌ای

۱-۷ الگوی معادلات همزمان

۲-۷ الگوی خود توضیح برداری