



Proceedings of the
47th Annual Iranian Mathematics Conference,
Kharazmi University, Karaj, Iran, 28-31 August 2016

مجموعه مقالات چهل و هفتمین کنفرانس ریاضی ایران
دانشگاه خوارزمی، کرج، ۱۰-۷ شهریور ۱۳۹۵



برازش مدل رگرسیونی پویا با اثرات تصادفی باداده‌های پانلی توسط روش ماکسیمم درستنمای

حسن جهانشاهی جواران* و ایوب شیخی

دانشگاه شهید باهنر کرمان، mohsen6622@yahoo.com

دانشگاه شهید باهنر کرمان، sheikhy.a@uk.ac.ir

چکیده

در این مقاله یک مسئله اساسی در مدل سازی مشاهدات پانلی تغییرپذیری بین واحدهای آزمایش است که به علت پیچیدگی محاسبات در استفاده از روش‌های متداول برآوردیابی، اغلب این اثرات ثابت در نظر گرفته می‌شوند. در این مقاله استنباط آماری پارامترهای مدل رگرسیونی پانلی پویا با اثرات تصادفی با روش ماکسیمم درستنمایی انجام می‌شود. در این مقاله مدل پیشنهادی از متغیر پاسخ تأخیری از گام زام است.

واژه‌های کلیدی: مشاهدات پانلی، اثرات ثابت، روش ماکسیمم درستنمایی

رده‌بندی موضوعی ریاضی (2010): 62M10، 91B84، 62P20