

التخصيص المفرد جبي لإستحان برمجيات احصائية 2

1

المحرف 101

1 التفسير الإحصائي للمودج 1
 $T_t = B\gamma_t + \mu_t$

المودج بدون ثابت وهو أمر منطقي، فلا يمكن فرض ثابت على لا شيء، زيادة الدخل بوحدة نقدية (مثلا مليون دينار) يؤدي إلى زيادة الحصلة الضريبية بقدر B_1 وحدة نقدية. (2 pts)

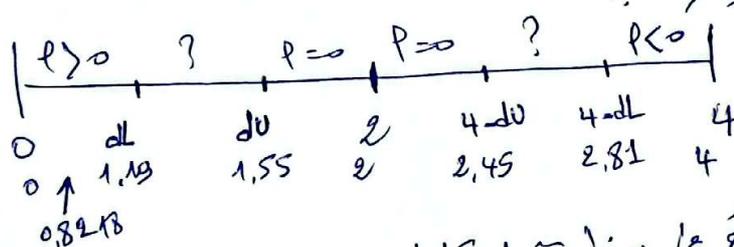
2 التفسير الإحصائي للمودج 1
 $Q_t = B_1L_t + B_2K_t + \mu_t$

ثبات الثابت بما دالة الإنتاج يعني $B_0 = 0$ ، المنطق الإحصائي لغيرها أنه إذا لم توجد عمال ($L=0$) ولم توجد رأس مال ($K=0$) فمن المستحيل أن يكون هناك إنتاج. (2 pts)

اقتصاديا B_1 و B_2 على التوالي يمثلان الإنتاجية الحدية للعمل ورأس المال، أي تعبيراً آخر كم يزيد الإنتاج بإضافة عامل واحد، وكل يزيد الإنتاج بإضافة T لة واحدة.

المحرف 102

1 مبرهن دربن واستون على نتائج التفسير $DW = 0,8218$ ، بوضع هذه القيمة



من قاعدة القرار الجيد: (3 pts)

أذن قيمة DW تقع في منطقة الارتباط، التي موجب، وبذلك النموذج المقدر لعاني من مشكلة الارتباط الذاتي للأخطاء، مما يرجح التأدي.

2 لمعالجة الارتباط الذاتي للأخطاء، مما يرجح التأدي على نتائج التفسير تقترح ما يلي:

- مراجعة الشكل الذي للنموذج، فقد يكون النموذج ذو صيغة متر بديهية بدلاً من الصيغة الخطية أو قد يكون ذو صيغة لوفار بديهية.
 - إدراج المتغير التابع كمتغير مستقل بدرجة تأخير واحدة.
 - الزيادة مما حدد المشاهدات وإن أمكن.
 - إدراج متغيرات مستقلة أخرى وجودها ضروري أو مهم على النموذج.
- (2 pts)

3] - اختبارات الكسف عند الارتباط الذاتي للأخطاء، بما في ذلك 1، ومن درجات

أعلى:

1- اختبارات الارتباط الذاتي من الدرجة الأولى،

• اختبار DW

• اختبار F_{DW} (حيث المتغير التابع يكون من ضمن المتغيرات المستقلة
بدرجة تأخير واحدة).

ب - اختبارات الارتباط الذاتي من درجات أعلى:

• اختبار Breusch - Godfrey للارتباط المتعدد.

• اختبار Ljung - Box

4] القائمة من Correlogram (اختبار Ljung Box) هو أنه يبين

لنا كنظره مبدئية وجود ارتباط ذاتي تسلسلي مما يسهل عليه.
• إكمال الفراغات:

$$Q\text{-stat} = n(n+2) \sum_{k=1}^h \hat{\rho}_k^2$$

$$Q_4 = 24(26) \left[\frac{(0.564)^2 + (0.448)^2 + (-0.151)^2 + (-0.192)^2}{20} \right] = 12.48$$

$$Q_5 = 24(26) \left[\frac{(0.564)^2 + (0.448)^2 + (-0.151)^2 + (-0.192)^2 + (0.058)^2}{19} \right] = 13.25$$

المسرين 03: (هل النموذج لعائني من مشكلة الارتباط الذاتي للأخطاء؟)

نتائج التقدير تبين أن النموذج لا يحتوي على الثابت وبذلك لا يمكننا

استخدام اختبار DW مما الكسف على الارتباط الذاتي للأخطاء
بما في ذلك الأولى.

3 pts

3

1 التعليق لإستيراد ملف EXCEL إلى برنامج EViews : توجب عدة

طريقة أسهلها :
File → Import → ~~Import from file~~ → select the folder → ok.
1 pt

2 التعليق لإنشاء ملف جديد على برنامج EViews : توجب أيضا عدة

طريقة أسهلها :
Ctrl + N → workfile create → select the workfile structure type
→ select the date specifications → ok. → ... 1 pt

3 التعليق إستخراج التباين الإحصائية على برنامج spss

Analyze → Descriptive statistics → Frequencies →
statistics → choose the statistics
1 pt