التمرين الأول (5 نقاط)

إليك نتائج دراسة الإستقرارية لسعر البترول ببرنامج eviews كما هو موضح في الجداول أدناه:

Augmented Dickey-Fuller Test Equation
Dependent Variable: D(SER01)
Method: Least Squares
Date: 01/06/25 Time: 20:46
Sample (adjusted): 1981 2015
Included observations: 35 after adjustments

الجدول 1

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
SER01(-1)	-0.220912	0.107395	-2.057005	0.0535
C	-0.177670	4.492002	-0.039552	0.0312
@TREND("1980")	0.517750	0.323008	1.602903	0.1188

R-squared	0.117154	Mean dependent var	0.399143
Adjusted R-squared	0.061976	S.D. dependent var	13.42577
S.E. of regression	13.00308	Akaike info criterion	8.050066
Sum squared resid	5410.564	Schwarz criterion	8.183382
Log likelihood	-137.8762	Hannan-Quinn criter.	8.096087
F-statistic	2.123197	Durbin-Watson stat	1.516182
Prob(F-statistic)	0.136195		

المطلوب:

- أدرس الاستقرارية حسب اختبار ديكي فولر
- هل السلسلة مستقرة أو لا في حالة غير مستقرة حدد نوع النموذج والأسلوب المناسب لجعلها مستقرة

Augmented Dickey-Fuller Test Equation
Dependent Variable: D(SER01)
Method: Least Squares
Date: 01/06/25 Time: 20:59
Sample (adjusted): 1981 2015
Included observations: 35 after adjustments

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
SER01(-1)	-0.093705	0.074058	-1.265292	0.2146
C	4.107554	3.694674	1.111750	0.2743

الجدول 2

R-squared	0.046269	Mean dependent var	0.399143
Adjusted R-squared	0.017368	S.D. dependent var	13.42577
S.E. of regression	13.30867	Akaike info criterion	8.070153
Sum squared resid	5844.981	Schwarz criterion	8.159030
Log likelihood	-139.2277	Hannan-Quinn criter.	8.100834
F-statistic	1.600963	Durbin-Watson stat	1.530774
Prob(F-statistic)	0.214628		

Null Hypothesis: SER01 has a unit root
Exogenous: None
Lag Length: 0 (Automatic - based on SIC, maxlag=2)

		t-Statistic	Prob.*
Augmented Dickey-Fuller test statistic		-0.627474	0.4383
Test critical values:	1% level	-2.632688	
	5% level	-1.950687	
	10% level	-1.611059	

*MacKinnon (1996) one-sided p-values.

الجدول 3

Augmented Dickey-Fuller Test Equation
Dependent Variable: D(SER01)
Method: Least Squares
Date: 01/06/25 Time: 21:03
Sample (adjusted): 1981 2015
Included observations: 35 after adjustments

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
SER01(-1)	-0.028392	0.045248	-0.627474	0.5345

R-squared	0.010548	Mean dependent var	0.399143
Adjusted R-squared	0.010548	S.D. dependent var	13.42577

التمرين 2

إليك نتائج انحدار الخطي البسيط لمتغيري الدخل والاستهلاك كما هو موضح أدناه:

View | Proc | Object | Print | Name | Freeze | Estimate | Forecast | Stats | Resids

Dependent Variable: CONSOMMATION
Method: Least Squares
Date: 01/05/25 Time: 22:27
Sample: 2010 2016
Included observations: 7

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	76.87708	22.62017		0.0193
INCOM	-0.345927	0.409698		0.4370

R-squared	0.124791	Mean dependent var	57.88571
Adjusted R-squared	-0.050251	S.D. dependent var	6.197695
S.E. of regression	6.351507	Akaike info criterion	6.770218
Sum squared resid	201.7082	Schwarz criterion	6.754764
Log likelihood	-21.69576	Hannan-Quinn criter.	6.579206
F-statistic	0.712919	Durbin-Watson stat	0.241774
Prob(F-statistic)	0.437000		

المطلوب

- عرف المتغيرات.
- أكمل القيم المفقودة في الجدول.
- فسر المعنوية الجزئية والكلية.
- أكتب معادلة الانحدار.

ملاحظات:

- يكتب الحل في وارد أو PDF أو على ورقة بخط واضح ومنظم ويبعث صورة ويرسل الحل عبر الأمايل: masterecogestion.entreprise@gmail.com
- غير مسموح إرسال الحل مكتوب في إمايل أي عمل يرسل بهذه الطريقة يرفض.
- مدة الامتحان جزئي ساعة وربع من ساعة 17 سا إلى 18 سا وربع أي عمل يرسل بعد المدة المحددة غير مقبول.