2- دراس ة أثر سعر الصرف الرسمي على التضخ م توحيد وحدة البيانات حتى يختفي أثرها على البيانات دراسة استقرارية السلاسل اعتمادا على اختباري ديكي فولر و KPSS تقدير نموذج الـVAR اختبار معنيوية المعلمات اختبار استقرارية البواقي وطبيعة توزيعها اختبار السببية المصدر: من إعداد الباحث ين 1) ● ,Gujarati) وبعد توحيد وحدة المتغيرين سعر الصرف والتضخم، يمثل الشكل الموالي سلوكهما حيث نعبر عن سعر الصرف بـEXCN باللون الأزرق ومعدل التضخم الشكل) 04(: التمثيل البياني لسلسلتي سعر الصرف و معدل التضخم في الجزائر بعد حذف أثر الوحدة 2-3-1- اختبار فيليب بيرون بدونهما: غير مستقر ة 0. 0995 0. 980 مع القاط ع غير مستقر ة 0. 37 ـ2. غير مستقر ة 0. 256 دون القاطع والاتجا ه وبالتالي السلسلتين غير مستقرتين، وبعد إجراء نفس الاختبار على الفرق الأول للسلسلتين تحصلنا على النتائج التالية: مستقر ة 0. 508 مع القاط ع 0014 ـ4. 851 مع القاطع والاتجا ه مستقر ة 0. 692 مستقر ة 0. 0003 ـ3. 804 دون القاطع والاتجا ه 05)5%(، يقوم اختبار ديكي فولر على فرضيتين: فرضية العدم 0H : وجود جذر الوحدة، نتائج اختبار على INFN نتائج اختبار على EXCN النماذ ج النتيجة Prob Tcl النتيجة Prob Tcl غير مستقر ة 0. المصدر: مخرجات برنامج Eviews10 من الجدول نلاحظ أن كل الاحتمالات أكبر من 0. 05 وبالتالي نقبل الفرضية الصفرية أن هناك جذر وحدة يؤثر على استقرار السلسلتين ما يستدعي اجراء الفرق الأول للسلسلتين الجدول) 04(: نتائج اختبار ديكي فولر على السلسلتين بعد الفرق الأول نتائج اختبار على DINFN نتائج اختبار على DEXCN النماذ ج 00 ـ6. 61 مستقر ة 0. 51 مع القاط ع مستقر ة . 60 مستقر ة 0. 0014 ـ4. 84 مع القاطع والاتجا ه مستقر ة 0. 00 ـ6. 69 مستقر ة 0. 0004 ـ3. المصدر: مخرجات برنامج Eviews10 حيث كل الاحتمالات أصغر من 0. 05 وبالتالي رفض الفرضية الصفرية وقبول الفرضية 1H أي غياب جذر الوحدة 2-4- اختبار التكامل المشترك وقد اعتمدنا على اختبار انجل وقرانجر والذي يقوم على مبدأ اختبار استقرارية البواقي بعد تقدير النموذج التالي: ● (2) الشكل05: منحنى correlogram للبواقي المصدر:مخرجات برنامج Eviews10 من المنحنى البياني يتباذر لنا، حيث أن أغلبية الرؤوس خارج مجال الثقة، وقد تحصلنا على النتائج التالية: نتائج اختبار بعد الفرق الأو ل نتائج اختبار على سلسلة البواق ي النماذ ج مستقر ة 0. 00 ـ6. 59 غير مستقرة 0. 874 ـ0. 53 مع القاط ع مستقر ة 0. 00 ـ6. 53 غير مستقرة 0. 57 مع القاطع والاتجا ه 00 ـ6. 34 غير مستقرة 0. 456 ـ0. 59 دون القاطع والاتجا ه المصدر: مخرجات برنامج Eviews10 كما اظهرت نتائج اختبار ديكي ف ولر أن سلسلة البواقي غير مستقرة، وتستقر بعد الفرق الأول وهذا ما يجعلنا نرفض فرضية وجود تكامل مشترك بين السلسلتين، وبالتالي يمكننا استخدام نماذج ا لـ5-2 VAR- نمذجة العلاقة بين السلسلتين اعتمادا على نماذج ا لـVAR 1-5-2 تحديد عدد الإبطاءات لتحديد عدد الابطاءات الم ثلى لنموذج ا لـVAR نعتمد على مقياسي AIC وSC وكانت النتائج كما يلي: الجدول)06(: نتائج اختبار AIC وSC لاختيار قيمة الإبطاء الإبطاءا ت معيار AIC معيار 1 628687 .5 548391 .5 0 SC 0 5 193707 .1 471042 .0 4 030390 .1 468318 .0 3 826039 .0 424558 .0 2 571080 .0 330192 .0.

lakhasly.com © تم تلخيص النص بواسطة موقع لخصلي