

دراسة أثر سعر الصرف الرسمي على التضخم م توحيد وحدة البيانات حتى يختفي أثرها على البيانات دراسة استقرارية -2 اختبار معنوية المعلمات اختبار استقرارية البواقي VAR تقدير نموذج الـ KPSS السلاسل اعتمادا على اختباري ديكي فولر و بعد توحيد وحدة المتغيرين سعر الصرف (1) ● Gujarati، وطبيعة توزيعها اختبار السببية المصدر: من إعداد الباحثين باللون الأزرق ومعدل التضخم الشكل) 04: EXCN والتضخم، يمثل الشكل الموالي سلوكهما حيث نعتبر عن سعر الصرف ب التمثيل البياني لسلسلتي سعر الصرف و معدل التضخم في الجزائر بعد حذف أثر الوحدة 2-3-1- اختبار فيليب بيرون بدونهما: غير مستقرة 0.0995 0.980 مع القاطع غير مستقرة 0.37 2. غير مستقرة 0.256 دون القاطع والاتجاه وبالتالي السلسلتين غير مستقرتين، وبعد إجراء نفس الاختبار على الفرق الأول للسلسلتين تحصلنا على النتائج التالية: مستقرة 0.508 مع القاطع 0.0014 4.851 مع القاطع والاتجاه مستقرة 0.692 0.0003 3.804 دون القاطع والاتجاه 5%، EXCN نتائج اختبار على INFN وجود جذر الوحدة، نتائج اختبار على H: يقوم اختبار ديكي فولر على فرضيتين: فرضية العدم 0 من الجدول نلاحظ أن كل Eviews10 غير مستقرة 0. المصدر: مخرجات برنامج Prob Tcl النتيجة Prob Tcl النموذج النتيجة الاحتمالات أكبر من 0.05 وبالتالي نقبل الفرضية الصفرية أن هناك جذر وحدة يؤثر على استقرار السلسلتين ما يستدعي إجراء نتائج الفرق الأول للسلسلتين الجدول) 04: نتائج اختبار ديكي فولر على السلسلتين بعد الفرق الأول نتائج اختبار على النموذج 00 61.6 60 مستقرة 0.51 مع القاطع مستقرة 0.60 0.0014 4.84 مع القاطع DEXCN اختبار على حيث كل الاحتمالات أصغر Eviews10 والاتجاه مستقرة 0.00 69.6 0.0004 3. المصدر: مخرجات برنامج أي غياب جذر الوحدة 2-4- اختبار التكامل المشترك وقد H من 0.05 وبالتالي رفض الفرضية الصفرية وقبول الفرضية 1 اعتمادنا على اختبار انجل وقرانجر والذي يقوم على مبدأ اختبار استقرارية البواقي بعد تقدير النموذج التالي: ● (2) الشكل 05: من المنحنى البياني يتبازر لنا، حيث أن أغلبية الرؤوس Eviews10 للبواقي المصدر: مخرجات برنامج correlogram منحنى خارج مجال الثقة، وقد تحصلنا على النتائج التالية: نتائج اختبار بعد الفرق الأول نتائج اختبار على سلسلة البواقي النموذج مستقرة 0.00 59.6 53.0 874.0 مع القاطع مستقرة 0.00 53.6 59.0 456.0 دون القاطع والاتجاه مستقرة 0.00 كما اظهرت نتائج Eviews10 ه 00 34.6 34.6 456.0 غير مستقرة 0.00 59.0 دون القاطع والاتجاه المصدر: مخرجات برنامج اختبار ديكي فولر أن سلسلة البواقي غير مستقرة، وتستقر بعد الفرق الأول وهذا ما يجعلنا نرفض فرضية وجود تكامل مشترك VAR نمذجة العلاقة بين السلسلتين اعتمادا على نماذج الـ 2-5- VAR بين السلسلتين، وبالتالي يمكننا استخدام نماذج الـ وكانت النتائج كما SC و AIC نعتمد على مقياسي VAR تحديد عدد الإبطاءات لتحديد عدد الإبطاءات المثل لنموذج الـ 2-5-1 SC 0 5. 548391 5. 628687 1 AIC معيار لاختبار قيمة الإبطاءات معيار SC و AIC يلي: الجدول) 06: نتائج اختبار 0. 330192 0. 571080 2 0. 424558 0. 826039 3 0. 468318 1. 030390 4 0. 471042 1. 193707 5 0.