



قدم به قدم، همراه دانشجو...

WWW.GhadamYar.Com

جامع ترین و به روزترین پرتال دانشجویی کشور (پرتال دانش)
با ارائه خدمات رایگان، تحصیلی، آموزشی، رفاهی، شغلی و...
برای دانشجویان

- (۱) راهنمای ارتقاء تحصیلی. (کاردانی به کارشناسی، کارشناسی به ارشد و ارشد به دکتری)
- (۲) ارائه سوالات کنکور مقاطع مختلف سالهای گذشته، همراه پاسخ، به صورت رایگان
- (۳) معرفی روش های مقاله و پایان نامه نویسی و ارائه پکیج های آموزشی مربوطه
- (۴) معرفی منابع و کتب مرتبط با کنکورهای تحصیلی (کاردانی تا دکتری)
- (۵) معرفی آموزشگاه ها و مراکز مشاوره تحصیلی معتبر
- (۶) ارائه جزوات و منابع رایگان مرتبط با رشته های تحصیلی
- (۷) راهنمای آزمون های حقوقی به همراه دفترچه سوالات سالهای گذشته (رایگان)
- (۸) راهنمای آزمون های نظام مهندسی به همراه دفترچه سوالات سالهای گذشته (رایگان)
- (۹) آخرین اخبار دانشجویی، در همه مقاطع، از خبرگزاری های پربازدید
- (۱۰) معرفی مراکز ورزشی، تفریحی و فروشگاه های دارای تخفیف دانشجویی
- (۱۱) معرفی همایش ها، کنفرانس ها و نمایشگاه های ویژه دانشجویی
- (۱۲) ارائه اطلاعات مربوط به بورسیه و تحصیل در خارج و معرفی شرکت های معتبر مربوطه
- (۱۳) معرفی مسائل و قوانین مربوط به سربازی، معافیت تحصیلی و امریه
- (۱۴) ارائه خدمات خاص ویژه دانشجویان خارجی
- (۱۵) معرفی انواع بیمه های دانشجویی دارای تخفیف
- (۱۶) صفحه ویژه نقل و انتقالات دانشجویی
- (۱۷) صفحه ویژه ارائه شغل های پاره وقت، اخبار استخدامی
- (۱۸) معرفی خوابگاه های دانشجویی معتبر
- (۱۹) دانلود رایگان نرم افزار و اپلیکیشن های تخصصی و...
- (۲۰) ارائه راهکارهای کارآفرینی، استارت آپ و...
- (۲۱) معرفی مراکز تایپ، ترجمه، پرینت، صحافی و ... به صورت آنلاین
- (۲۲) راهنمای خرید آنلاین ارزی و معرفی شرکت های مطرح
- (۲۳)



WWW.GhadamYar.Ir

WWW.PortaleDanesh.com

WWW.GhadamYar.Org

۰۹۱۲ ۳۰ ۹۰ ۱۰۸

باما همراه باشید...

۰۹۱۲ ۰۹ ۰۳ ۸۰۱

WWW.GhadamYar.com

بسم الله الرحمن الرحيم

آموزش رگرسیون های هم انباشته

«تخمین به روش DOLS در نرم افزار Eviews»

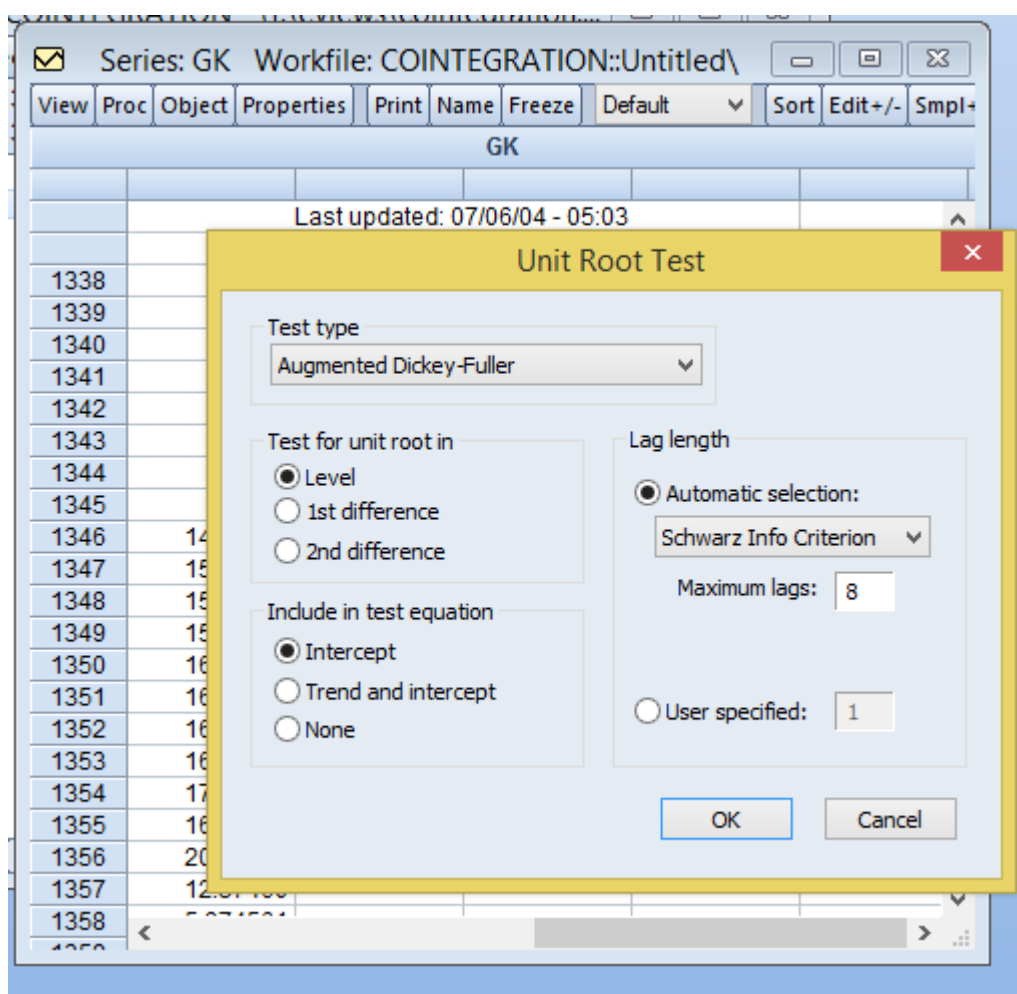
بخش دوم (آموزش نرم افزاری)

تهیه شده توسط: حسین خاندانی

نظارت و مشاوره: دکتر هادی امیری

آموزش تخمین مدل حداقل مربعات پویا (DOLS)

(۱) گام اول بررسی مانایی متغیرها



Series: GK Workfile: COINTEGRATION::Untitled\

View Proc Object Properties Print Name Freeze Sample Genr Sheet Graph Stats

Augmented Dickey-Fuller Unit Root Test on GK

Null Hypothesis: GK has a unit root
Exogenous: Constant
Lag Length: 0 (Automatic - based on SIC, maxlag=8)

	t-Statistic	Prob.*
Augmented Dickey-Fuller test statistic	-1.864332	0.3444
Test critical values: 1% level	-3.639407	
5% level	-2.951125	
10% level	-2.614300	

با یکبار تفاضل گیری:

Unit Root Test

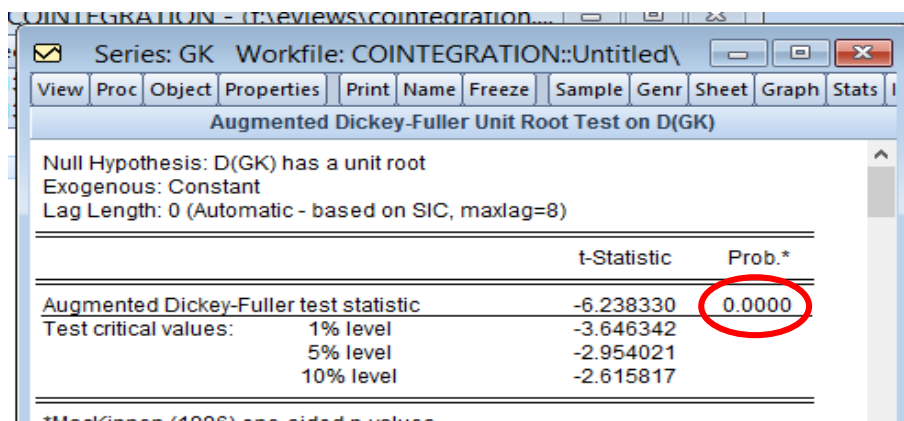
Test type
Augmented Dickey-Fuller

Test for unit root in
☐ Level
☒ 1st difference
☐ 2nd difference

Include in test equation
☒ Intercept
☐ Trend and intercept
☐ None

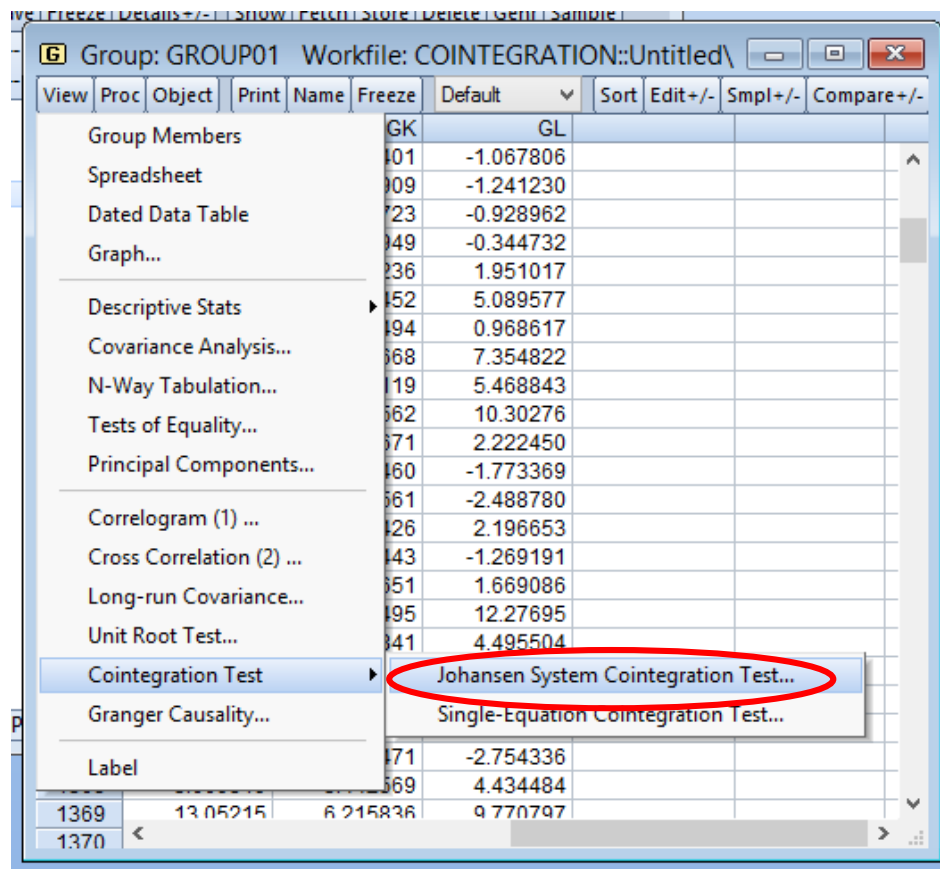
Lag length
☒ Automatic selection:
 Schwarz Info Criterion
 Maximum lags: 8
☐ User specified: 1

OK Cancel



(۲) گام دوم انجام آزمون هم‌انباشتگی:

در صورتی که تنها یک بردار هم‌انباشتگی تایید شد میتوان از این روش استفاده نمود.



ive | Freeze | Details+/- | Show | Fetch | Store | Delete | Genr | Sample |

Group: GROUP01 Workfile: COINTEGRATION::Untitled\

View Proc Object Print Name Freeze Sample Sheet Stats Spec

Johansen Cointegration Test

Date: 07/09/15 Time: 23:24
 Sample (adjusted): 1350 1380
 Included observations: 31 after adjustments
 Trend assumption: Linear deterministic trend
 Series: GYNO GK GL
 Lags interval (in first differences): 1 to 3

Unrestricted Cointegration Rank Test (Trace)

Hypothesized No. of CE(s)	Eigenvalue	Trace Statistic	0.05 Critical Value	Prob.**
None *	0.647505	45.40195	29.79707	0.0004
At most 1	0.257954	13.07765	15.49471	0.1120
At most 2	0.116192	3.828982	3.841466	0.0504

Trace test indicates 1 cointegrating eqn(s) at the 0.05 level
 * denotes rejection of the hypothesis at the 0.05 level
 **Mackinnon-Haug-Michelis (1999) p-values

۳) گام سوم تخمین مدل DOLS:

در equation Estimation از منوی کشویی Method گزینه Cointegration Regression را انتخاب می نماییم.

Equation Estimation

Specification Options

Equation specification
Dependent variable followed by list of regressors including ARMA and PDL terms, OR an explicit equation like $Y=c(1)+c(2)*X$.

gyno gk gl c

Estimation settings
Method: LS - Least Squares (NLS and ARMA)
Sample: 1346 1380

OK Cancel

Equation Estimation

Specification Options

Equation specification
Dependent variable followed by list of cointegrating regressors

gyno gk gl

Trend specification
Constant (Level)

Deterministic regressors

Cointegrating regressors specification
Additional trends
None

Additional deterministic regressors

☐ Estimate using differenced data

Nonstationary estimation settings
Method: Fully-modified OLS (FMOLS)
Long-run variance calculation: Options

Estimation settings
Method: COINTREG - Cointegrating Regression
Sample: 1346 1380

OK Cancel

سپس در پنجره جدید که باز میشود از منوی Method آن نیز گزینه DOLS را انتخاب می کنیم.

Equation Estimation

Specification Options

Equation specification

Dependent variable followed by list of cointegrating regressors

gyno gk gl

Trend specification

Constant (Level)

Deterministic regressors

Cointegrating regressors specification

Additional trends

None

Additional deterministic regressors

Nonstationary estimation settings

Method: Dynamic OLS (DOLS)

Lag & lead method: Schwarz

Max lag & lead: *

(Use * for obs-based max lengths)

Estimation settings

Method: COINTREG - Cointegrating Regression

Sample: 1346 1380

OK Cancel

حال در کادر بالایی آن اسامی متغیرهای وابسته و مستقلی که میخواهید وقفه پسین و پیشین برای آنها لحاظ شود را وارد نمایید. از گزینه trend specification نیز میتوانید مدل را با حالات با عرض از مبدا روند و بدون آن و یا مجذور زمان تصریح نمایید.

در قسمت Deterministic نیز میتوانید متغیرهای که لازم وقفه پسین و یا پیشین برای آن وارد شوند را وارد نمایید.

از منوی Lag & Lead Method نیز میتوانید انتخاب وقفه بهینه را براساس معیارهای آکایک، شوارتز، کوبین انتخاب نمایید و یا در غیر این صورت از گزینه Fixed استفاده کرده و خودتان وقفه های بهینه را وارد نمایید. در صورتی که حجم نمونه شما زیر صد است وقفه ها را بسیار پایین انتخاب نمایید و یا از معیار شوارتز استفاده نمایید.

Equation Estimation

Specification Options

Equation specification
Dependent variable followed by list of cointegrating regressors
gyno gk gl

Trend specification
Constant (Level)

Deterministic regressors

Cointegrating regressors specification
Additional trends
None

Additional deterministic regressors

Nonstationary estimation settings
Method: Dynamic OLS (DOLS)

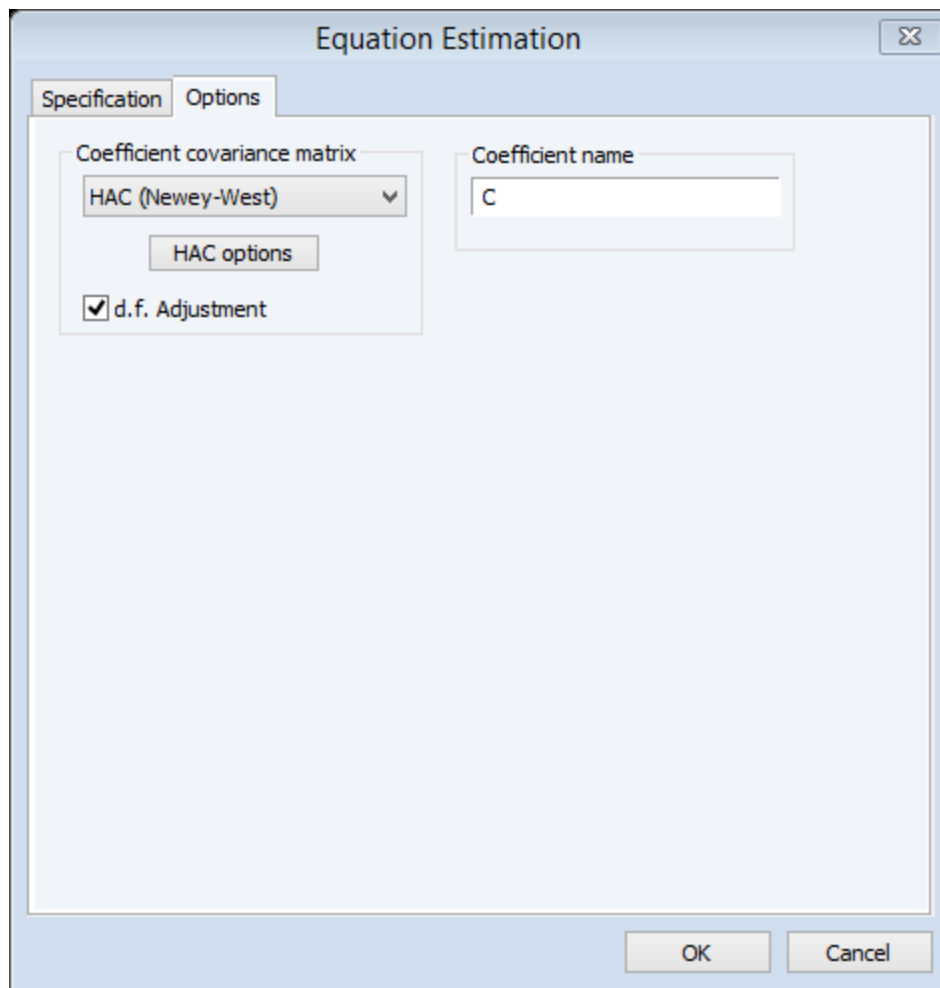
Lag & lead method: Fixed Lags: 1 Leads: 1

Estimation settings
Method: COINTREG - Cointegrating Regression

Sample: 1346 1380

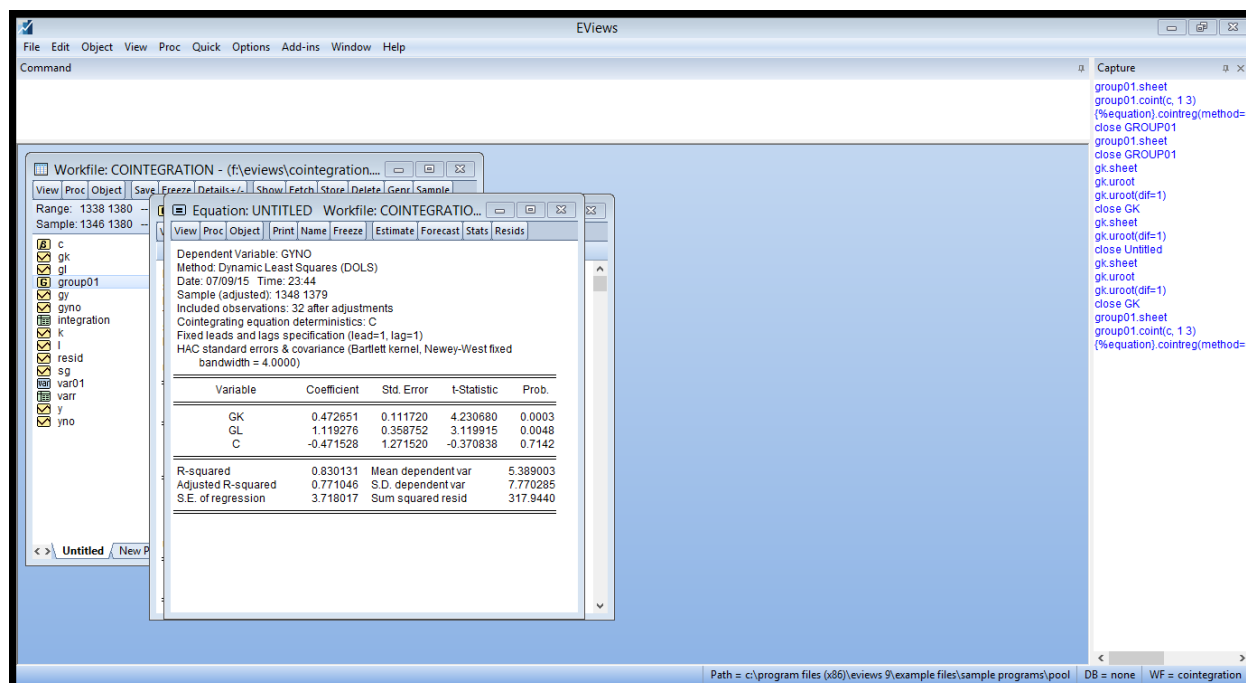
OK Cancel

همچنین شما میتوانید در option رگرسیون را نسبت به دو مشکل ناهمسانی و خودهمبستگی مقاوم نمایید.



تخمین نهایی مدل:

در تخمین نهایی ضرایب وقفه‌های پسین و پیشین گزارش نمی‌شود.



Econometrics.blog.ir

آموزش نرم افزارهای اقتصادسنجی