

السنة الجامعية: 2024/2023

التخصص: أولى ماستر محاسبة وتدقيق

الشعب: علوم مالية ومحاسبية

تاريخ الامتحان: 2024/05/23

امتحان مقياس: النمذجة الإحصائية

السادسي: الثاني

العلامة: 20/20

الاسم واللقب: الفوج: رقم التسجيل:
الدرجة: العادية أستاذ المقياس: زكريا جرفي مدة الامتحان: ساعة واحدة

حدد معنى الأرقام الموجودة في كل صورة

المعنى	الصور	تمرين
01: فضاء كتابة عناصر المعادلة الخطية، المتغير التابع ثم الثابت ثم المتغير المستقل	Equation Estimation Specification Options Equation specification Dependent variable followed by list of regressors including ARMA and PDL terms, OR an explicit equation like $Y=c(1)+c(2)*X$. y c x1 01 Estimation settings Method: LS - Least Squares (NLS and ARMA) 02 Sample: 1990 2022 03 OK Annuler	01 03
02: تحديد الطريقة الإحصائية المعتمدة في بناء النموذج - LS - ARDL - PANEL -		
03: العينة الإحصائية المختارة		
01: معلومات حول النموذج	Equation: UNTITLED Workfile: IMP+EXP+RES+OP+GDP... View Proc Object Print Name Freeze Estimate Forecast Stats Resids Dependent Variable: Y Method: Least Squares Date: 05/14/24 Time: 19:48 Sample (adjusted): 1990 2020 Included observations: 31 after adjustments 01 Variable Coefficient Std. Error t-Statistic Prob. 02 C 2.101529 0.109862 19.12874 0.0000 X1 0.370417 0.029683 12.47901 0.0000 R-squared 0.843010 Mean dependent var 3.304667 Adjusted R-squared 0.837597 S.D. dependent var 0.727713 S.E. of regression 0.293311 Akaike info criterion 0.446847 Sum squared resid 2.494111 Schwarz criterion 0.539362 Log likelihood -4.926123 Hannan-Quinn criter. 0.477004 F-statistic 155.7257 Durbin-Watson stat 0.728629 Prob(F-statistic) 0.000000 03 نتائج التقدير كما يلي: Y=..... 04	02 05 05
02: التحليل الاحصائي للمقدرات		
03: تشخيص البواقي		
04: نتائج التقدير: $Y=2.10+0.37X1$		
05: 31 after adjustments عدد مشاهدات العينة (31 مشاهدة)		

المعنى	الصور	تمرين																																
01: الاستقرارية عند الثابت	UNIT ROOT TEST RESULTS TABLE (ADF) Null Hypothesis: the variable has a unit root <table><thead><tr><th></th><th>At Level</th><th>X1</th><th>X2</th></tr></thead><tbody><tr><td>With Constant</td><td>t-Statistic -1.2569 Prob. 0.6360 n0</td><td>-2.1924 0.2135 n0</td><td>0.7396 0.9911 n0</td></tr><tr><td>With Constant & Trend</td><td>t-Statistic -0.7783 Prob. 0.9567 n0</td><td>-3.2322 0.1002 n0</td><td>-2.1641 0.4912 n0</td></tr><tr><td>Without Constant & Trend</td><td>t-Statistic 0.1871 Prob. 0.7335 n0</td><td>-1.7002 0.0839 n0</td><td>3.9163 0.9999 n0</td></tr><tr><th></th><th>At First Difference</th><th>d(Y)</th><th>d(X2)</th></tr><tr><td>With Constant</td><td>t-Statistic -4.2036 Prob. 0.0028 ***</td><td>-0.3187 0.9091 n0</td><td>-4.4811 0.0014 ***</td></tr><tr><td>With Constant & Trend</td><td>t-Statistic -4.7328 Prob. 0.0039 ***</td><td>-5.0779 0.0015 ***</td><td>-4.5235 0.0061 ***</td></tr><tr><td>Without Constant & Trend</td><td>t-Statistic -4.2568 Prob. 0.0001 ***</td><td>-1.3810 0.1517 n0</td><td>-2.9589 0.0045 ***</td></tr></tbody></table> Notes: a: (*)Significant at the 10%; (**)Significant at the 5%; (***) Significant at the 1% and (no) Not Significant b: Lag Length based on SIC c: Probability based on MacKinnon (1996) one-sided p-values. This Result is The Out-Put of Program Has Developed By: Dr. Imadeddin AlMosabbeh College of Business and Economics Qassim University-KSA		At Level	X1	X2	With Constant	t-Statistic -1.2569 Prob. 0.6360 n0	-2.1924 0.2135 n0	0.7396 0.9911 n0	With Constant & Trend	t-Statistic -0.7783 Prob. 0.9567 n0	-3.2322 0.1002 n0	-2.1641 0.4912 n0	Without Constant & Trend	t-Statistic 0.1871 Prob. 0.7335 n0	-1.7002 0.0839 n0	3.9163 0.9999 n0		At First Difference	d(Y)	d(X2)	With Constant	t-Statistic -4.2036 Prob. 0.0028 ***	-0.3187 0.9091 n0	-4.4811 0.0014 ***	With Constant & Trend	t-Statistic -4.7328 Prob. 0.0039 ***	-5.0779 0.0015 ***	-4.5235 0.0061 ***	Without Constant & Trend	t-Statistic -4.2568 Prob. 0.0001 ***	-1.3810 0.1517 n0	-2.9589 0.0045 ***	03
		At Level	X1	X2																														
With Constant		t-Statistic -1.2569 Prob. 0.6360 n0	-2.1924 0.2135 n0	0.7396 0.9911 n0																														
With Constant & Trend		t-Statistic -0.7783 Prob. 0.9567 n0	-3.2322 0.1002 n0	-2.1641 0.4912 n0																														
Without Constant & Trend		t-Statistic 0.1871 Prob. 0.7335 n0	-1.7002 0.0839 n0	3.9163 0.9999 n0																														
		At First Difference	d(Y)	d(X2)																														
With Constant	t-Statistic -4.2036 Prob. 0.0028 ***	-0.3187 0.9091 n0	-4.4811 0.0014 ***																															
With Constant & Trend	t-Statistic -4.7328 Prob. 0.0039 ***	-5.0779 0.0015 ***	-4.5235 0.0061 ***																															
Without Constant & Trend	t-Statistic -4.2568 Prob. 0.0001 ***	-1.3810 0.1517 n0	-2.9589 0.0045 ***																															
02: الاستقرارية عند الثابت والاتجاه العام	06																																	
03: الاستقرارية بدون الثابت واتجاه عام																																		
04: الاستقرارية عند المستوى																																		
05: الاستقرارية عند الفرق الأول																																		
06: ضع عنوانا مناسباً لهذا الجدول؛ دراسة الاستقرارية باستخدام اختبار ديكي فولر المطور ADF																																		

Equation: UNTITLED Workfile: IMP+EXP+RES+OP+GDP... [] [X]

View Proc Object Print Name Freeze Estimate Forecast Stats Resids

Dependent Variable: Y
 Method: Least Squares
 Date: 05/14/24 Time: 20:09
 Sample (adjusted): 1990 2020
 Included observations: 31 after adjustments

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	2.090045	0.111946	18.67005	0.0000
X1	0.400877	0.051970	7.713642	0.0000
X2	-9.70E-06	1.35E-05	-0.716996	0.4793

R-squared	0.845841	Mean dependent var	3.304667
Adjusted R-squared	0.834830	S.D. dependent var	0.727713
S.E. of regression	0.295751	Akaike info criterion	0.493169
Sum squared resid	2.449125	Schwarz criterion	0.631942
Log likelihood	-4.644122	Hannan-Quinn criter.	0.538406
F-statistic	76.81525	Durbin-Watson stat	0.777811
Prob(F-statistic)	0.000000		

1- حدد نتائج التقدير: 1ن

$$Y = 2.09 + 0.40X1 - 9.7 \times 10^{-6}X2$$

04

06ن

2- قدم التحليل الاحصائي والاقتصادي لهذا النموذج: 4ن - R^2 (معامل التحديد): يقيس القوة التفسيرية للنموذج؛ 84.58% من التباين في المتغير التابع سببه التغير في المتغير المستقل. - التأثير الموجب والمعنوي احصائيا للمتغير $X1$ ، لأن معلمته معنوية احصائيا ($Pob = 0.000 < 0.05$) - التأثير السالب وغير المعنوي احصائيا للمتغير $X2$ ، لأن معلمته غير معنوية احصائيا ($Pob = 0.4793 > 0.05$) - أو مقارنة قيمة T مع القيم الجدولية 1.96. - قيمة الثابت 2.09 والتي تدل على قيمة Y في حال قيمة متغيرات المستقلة تساوي 0. - النموذج معنوي احصائيا لأن مستوى الدلالة لفيزر أقل من 0.05 ($Prob F = 0.000 < 0.05$)	06ن
--	-----