جامعة العربي بن مهيدي – أم البواقي-
كلية العلوم الاقتصادية والعلوم التجارية وعلوم التسيير
قسم العلوم الاقتصادية

السنة الجامعية: 2024 - 2025
المستوى: أولى ماستر
التخصص اقتصاد كمي
المدة: ساعة و نصف

يوم : 2025/01/18

امتحان الدورة العادية في مقياس اقتصاد قياسي ديناميكي

التمرين الأول: (8 نقاط)

أولا -أجب باختصار عن مايلي :

ما الفرق بين النموذج الساكن والنموذج الديناميكي ؟
ما ذا تمثل lag وما هي العوامل المؤثرة بها؟

ثانيا :أكتب معادلة النموذج َ(ardl(1 ,2,3

ثالثا: إليك المعادلات التالية :

$$Y_t=8.37+0.171x_t$$

$$Y_t=8.37+0.111x_t+0.064x_{t-1}$$

$$Y_t=8.37+0.109x_t+0.071x_{t-1}-0.055x_{t-2}$$

$$Y_t=8.37+0.108x_t+0.063x_{t-1}+0.022x_{t-2}-0.020x_{t-3}$$

اختر نموذج الانحدار الأفضل وفق ALT

رابعا: لديك المعادلة التالية :

$$Y_{t-1} = \alpha + \beta_0 X_{t-1} + \beta_0 \lambda X_{t-2} + \beta_0 \lambda^2 X_{t-3} + \cdots + u_{t-1}$$

أنشأ تحويلة koyck ؟

التمرين الثاني: (6 نقاط)

أولا :أملء الجدول التالي :

اسم النموذج	شرط الاستقرارية	عدد العلاقات في النموذج	وجود السببية
		1	
Ardl	I(0) ; I(1)		
			موجودة

ثانيا : ما الفرق بين single equation co integration test وgranger causality

التمرين الثالث: (6نقاط)

لديك نتائج اختبارات بمخرجات برمجية eviews12 قمت بدراستها ، قم بتسميتها ، وحلل النتائج إحصائيا

الجدول رقم 1

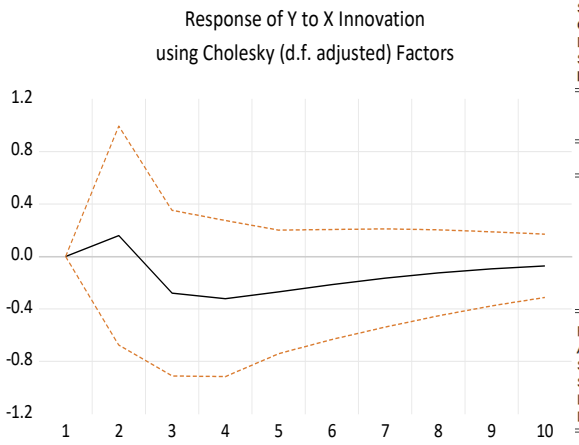
ARDL Error Correction Regression
Dependent Variable: D(Y)
Selected Model: ARDL(4, 0, 3)
Case 2: Restricted Constant and No Trend
Date: 01/16/24 Time: 23:58
Sample: 2000 2020
Included observations: 17

ECM Regression
Case 2: Restricted Constant and No Trend

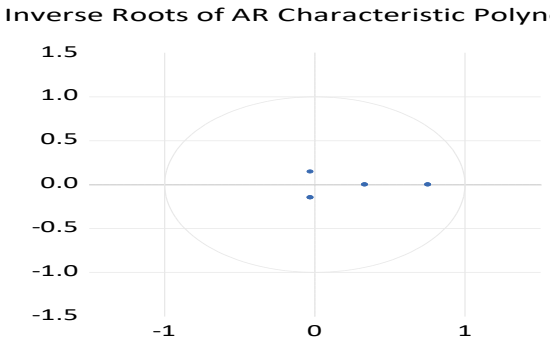
Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
D(Y(-1))	0.391868	0.112827	3.473179	0.0104
D(Y(-2))	0.032185	0.102591	0.313719	0.7629
D(Y(-3))	0.205420	0.100877	2.036351	0.0811
D(X1)	0.001705	0.000736	2.317893	0.0536
D(X1(-1))	-0.001145	0.001085	-1.055462	0.3263
D(X1(-2))	0.001144	0.000513	2.230407	0.0609
CointEq(-1)*	-0.894489	0.142514	-6.276488	0.0004

R-squared	0.927215	Mean dependent var	-0.004912
Adjusted R-squared	0.883544	S.D. dependent var	0.039371
S.E. of regression	0.013436	Akaike info criterion	-5.488918
Sum squared resid	0.001805	Schwarz criterion	-5.145830
Log likelihood	53.65580	Hannan-Quinn criter.	-5.454814
Durbin-Watson stat	3.016194		

الشكل رقم 1



الشكل رقم 2



د .عوام نسرين

بالتوفيق

جامعة العربي بن مهيدي – أم البواقي-
كلية العلوم الاقتصادية والعلوم التجارية وعلوم التسيير
قسم العلوم الاقتصادية

السنة الجامعية: 2024 - 2025
المستوى: أولى ماستر
التخصص:اقتصاد كمي
المدة: ساعة و نصف

يوم : 2025/01/18

الإجابة النموذجية لامتحان الدورة العادية في مقياس اقتصاد قياسي ديناميكي

	التمرين الأول	العلامة
1	**ما الفرق بين النموذج الساكن و النموذج الديناميكي** النموذج الساكن يعتمد على العلاقة بين المتغيرات عند نقطة زمنية واحدة، دون تأخير زمني ، لكن النموذج الديناميكي يأخذ في الاعتبار التأثيرات الزمنية ، حيث يعتمد المتغير التابع على المتغير المستقل الحالي والقيم السابقة للمتغيرات المستقلة و القيم السابقة للمتغير التابع نفسه	01
2	**تعريف lag** هي فترة التأخير أو فترة الإبطاء، تشير إلى التأخر الزمني بين حدث ما و تأثيره ، يستخدم لتمثل القيم السابقة للمتغيرات التي تؤثر على المتغير التابع أهم العوامل المؤثرة فيه هي : عوامل نفسية، مؤسسية ، فنية	01
3	**معادلة النموذج** $ARDL(1,2,3)$ المتغير التابع بفترة ابطاء واحدة ، المتغير المستقل الاول بفترتي ابطاء ، و المتغير المستقل الثاني بثلاث فترات ابطاء $_t\varepsilon + _{t-3,2}\gamma_3 X + _{t-2,2}\gamma_2 X + _{t-1,2}\gamma_1 X + _{t,2}\gamma_0 X + _{t-2,1}\alpha_2 X + _{t-1,1}\alpha_1 X + _{t,1}\alpha_0 X + _{t-1}\phi_1 Y +$	02
4	النموذج الانحدار الافضل وفق ALT $Y_t=8.37+0.111x_t+0.064x_{t-1}$ وذلك لأن إشارة المعلمة تغيرت و أصبحت سالبة	02
5	تحويلة koyck $_t\varepsilon + _{t-1}\lambda Y + _t\beta_0 X + \alpha = _t Y$ إدخال التأخير $_{t-1}Y$ ضمن المعادلة. $_t\varepsilon + _{t-1}\lambda Y + _t\beta_0 X + \alpha = _t Y$	02
	المجموع	8

السؤال الثاني	النقاط

1		4

اسم النموذج	شرط الاستقرارية	عدد العلاقات في النموذج	وجود السببية
التكامل المشترك جوهانسن و انجل جرانجر	**I(1) ; I(1)**	1	**غير موجودة**
Ardl	I(0) ; I(1)	**1**	**غير موجودة**
Var	**I(0) ; I(1) I(2)**	**2 في الاتجاهين**	موجودة

2	الفرق بين single equation co integration test وgranger causality single equation co integration test يوضح اختبار التكامل المشترك انجل جرانجر ، ويضح مدى وجود علاقة توازنية طيلة الأجل بين المتغيرين granger causality : اختبار السببية لانجل جرانجر ، يوضح اتجاه العلاقة السببية بين متغيرين	02
المجموع		06

	السؤال الثالث	النقاط
1	الجدول الأول : الفترة القصيرة في نموذجardl Ecm معلمة نموذج تصحيح الخطأ سالبة و معنوية ثم يتم حساب فترة العودة للتوازن	2
2	الشكل الأول : الاستجابة يوضح الطالب استجابة المتغير ومختلف الصدمات السالبة و الموجبة	2
3	الشكل الثاني : اختبار جذر الواحدة استقرارية النموذج في var نلاحظ ان كل الجذور داخل الدائرة أي هي اقل من الواحد و بالتالي نموذج Varمستقر	2
المجموع		8