Pr,bechichi walid

IHS & Information Handling Services

Eviews Econometric views

Presentation 2025 / 2024

EVIEWS GUIDE TO ACCOMPANY







هی ان نقوم

الأول وتليه

ثم نظغط على

Equation

تظهرلنا النافذةالخاصة بالمعادلات التى يمكن استخدامها حيث نلاحظ ان المعادلة y x1 x2 c تكون مكتوبة تلقائيا وذلك لان البرناج يفهم أن أول متغيرتم تحديده هوالمتغير التابع y والبقية متغيرات مستقلة x1 x2 وهنا لدينا متغير مستقل واحد فنحن في انحدار بسيط كما نلاحظ ان هناك <mark>C</mark> وهو عبارة عن ثابت يكتب دائما في معادلة الانحدار لان معادلة الانحدار تحتوي على متغيرتابع ومتغير او متغيرات مستقلة ومعلمات تتمثل في الثابت ومعامل المتغير المستقل







Adjusted R - تبين لنا قيمة squared درجة تفسير المتغيرات المستقلة للتغير الحاصل في المتغير التابع وهنا نلاحظ أن المتغير يفسر بنسبة 64,89 بالمائة التغير الحاصل في المتغي التابع والبقية تفسره متغيرات اخرى

ثانيا: لابد من معرفة هل النموذج معنوي أم لا وذلك من خلال قيمة -Prop(F من خلال قيمة *با أنها* (statistic ونلاحظ هنا أنها تساوي 0,00168 وهي اقل من 5 بالمائة وهذا معناه أن النموذج معنوي

Equation: UNTI	TLED Wo	rkfile: Ul	NTITLED::Unt	titled\ 🗖	
View Proc Object	Print Name	Freeze	Estimate For	ecast Stats Res	ids
Dependent Variab Method: Least Squ Date: 01/15/25 T Sample: 2015 202 Included observati	le: Y Jares ime: 22:31 4 ons: 10		لتابع	المتغيرا	
Variable	Coe	fficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
X1 X2 C	0.9 -0.2 18	01854 255989 .87202	0.206035 0.104048 5.289871	4.377193 -2.460294 3.567577	0.0032 0.0434 0.0091
R-squared Adjusted R-square S.E. of regression Sum squared resi Log likelihood F-statistic Prob(F-statistic)	0.9 ed 0.8 2.1 d 31 -19 38 0.0	916507 92652 20263 .46860 .92141 .41957 000168	Mean depe S.D. deper Akaike info Schwarz c Hannan-Qu Durbin-Wa	ndent var odent var criterion riterion uinn criter. tson stat	21.90000 6.471304 4.584282 4.675058 4.484702 2.155616

إحصائية داربن و اتسن مهمة لانها تبين لنا هل النموذج يعني من مشكلة الارتباط الذاتي للأخطاء أم لا ونلاحظ هنا أن إحصائية Durbin-Watson stat تساوي 2,155616 وحتى نعرف هل النموذج يخلو من مشكلة الارتباط الذاتي للأخطاء أم لا يجب الرجوع الى جدول Durbin-Watson وهذا ما سيتم توظيحه بالتفصيل فيما يأتي,

أولا: كما هو معلوم في معادلة الانحداريجب علينا معرفة هل المعلمات معنوبة ام لا وهنا نلاحظ أن القيمة الاحتمالية للمتغير x2 هي 0,0030 والقيمة الاحتمالية للمتغير c هي 0,000 وبماانالقيمة الاحتمالية أقل من 5 بالمائة أي 0,05 فهي معنوبة أى مقبولة ومفسرة

























طريقة أخرى



التشارير



Equa





quation Estimation X	Equation: UNTITLE	D Workfile: Ul	NTITLED::Untit	iled\ 🗖	
Specification Options	View Proc Object Print	Name Freeze	Estimate Fored	ast Stats Res	ids
Equation specification <u>Dependent variable followed by list or regressors including ARMA</u> and PDL terms, OR an explicit equation like Y=c(1)+c(2)*X. Y x1 x2 c	Dependent Variable: Y Method: Least Square: Date: 01/15/25 Time: Sample: 2015 2024 Included observations:	s 22:49 : 10			
	Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
y xI x2 c Ital	X1 X2 C	0.901854 -0.255989 18.87202	0.206035 0.104048 5.289871	4.377193 -2.460294 3.567577	0.0032 0.0434 0.0091
Estimation settings Method: LS - Least Squares (NLS and ARMA) Sample: 2015 2024	R-squared Adjusted R-squared S.E. of regression Sum squared resid Log likelihood F-statistic Prob(F-statistic)	0.916507 0.892652 2.120263 31.46860 -19.92141 38.41957 0.000168	Mean depen S.D. depend Akaike info c Schwarz cri Hannan-Qui Durbin-Wats	dent var lent var riterion terion nn criter. son stat	21.90000 6.471304 4.584282 4.675058 4.484702 2.155616

Annuler

ОК







Adjusted R - تبين لنا قيمة squared درجة تفسير المتغيرات المستقلة للتغير الحاصل في المتغير التابع وهنا نلاحظ أن المتغير يفسر بنسبة 64,89 بالمائة التغير الحاصل في المتغي التابع والبقية تفسره متغيرات اخرى

ثانيا: لابد من معرفة هل النموذج معنوي أم لا وذلك من خلال قيمة -Prop(F من خلال قيمة *با أنها* (statistic ونلاحظ هنا أنها تساوي 0,00168 وهي اقل من 5 بالمائة وهذا معناه أن النموذج معنوي

Equation: UNTI	TLED Wo	rkfile: Ul	NTITLED::Unt	titled\ 🗖	
View Proc Object	Print Name	Freeze	Estimate For	ecast Stats Res	ids
Dependent Variab Method: Least Squ Date: 01/15/25 T Sample: 2015 202 Included observati	le: Y Jares ime: 22:31 4 ons: 10		لتابع	المتغيرا	
Variable	Coe	fficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
X1 X2 C	0.9 -0.2 18	01854 255989 .87202	0.206035 0.104048 5.289871	4.377193 -2.460294 3.567577	0.0032 0.0434 0.0091
R-squared Adjusted R-square S.E. of regression Sum squared resi Log likelihood F-statistic Prob(F-statistic)	0.9 ed 0.8 2.1 d 31 -19 38 0.0	916507 92652 20263 .46860 .92141 .41957 000168	Mean depe S.D. deper Akaike info Schwarz c Hannan-Qu Durbin-Wa	ndent var odent var criterion riterion uinn criter. tson stat	21.90000 6.471304 4.584282 4.675058 4.484702 2.155616

إحصائية داربن و اتسن مهمة لانها تبين لنا هل النموذج يعني من مشكلة الارتباط الذاتي للأخطاء أم لا ونلاحظ هنا أن إحصائية Durbin-Watson stat تساوي 2,155616 وحتى نعرف هل النموذج يخلو من مشكلة الارتباط الذاتي للأخطاء أم لا يجب الرجوع الى جدول Durbin-Watson وهذا ما سيتم توظيحه بالتفصيل فيما يأتي,

أولا: كما هو معلوم في معادلة الانحداريجب علينا معرفة هل المعلمات معنوبة ام لا وهنا نلاحظ أن القيمة الاحتمالية للمتغير x2 هي 0,0030 والقيمة الاحتمالية للمتغير c هي 0,000 وبماانالقيمة الاحتمالية أقل من 5 بالمائة أي 0,05 فهي معنوبة أى مقبولة ومفسرة





اختبار النموذج: أولا يجب علينا اختبار البواقي ولكن قبل ذلك نلقي عليها نظرة

قبل كل شيء نستعرض البواقي

البواقي	Equation: UNTITLED Workfile: UN	JTITI ED:'Untitled\	حتى نقوم برسم	
Residual	View Proc Object Print Name Freeze	Estimate Forecast Stats Resids	السلسلة نذهب	Equation: UNTITLED Workfile: UNTITLED::Untitled
هي: الفرق	Representations		الى النافذة التي	View Proc Object Print Name Freeze Estimate Forecast Stats Resids
يين القيم	Estimation Output		تعض لنا	2015 12.0000 12.8975 -0.89753 I I ^
	Coefficient Labels			2016 21.0000 16.7492 4.25085
الحقيقية	Actual, Fitted, Residual	Actual,Fitted,Residual Table	التمودج	2018 24.0000 22.5266 1.47342
والقيم	ARMA Structure	Actual,Fitted,Residual Graph	ونظغط على	
المقدرة	Gradients and Derivatives	Residual Graph	View في شريط	2021 21.0000 21.7586 -0.75862
	Covariance Matrix	Standardized Residual Graph	الأدمات ثم	
أ با	Coefficient Diagnostics	5.289871 3.567577 0.0091		2024 30.0000 31.4112 -1.41124 •
ايضا	Residual Diagnostics	ean dependent var 21.90000	نطعط على	
الخطأ	Stability Diagnostics	2. dependent var 6.471304	Actual fitted	بيبن السم الجدول يبين لنا القيمة الحالية
العشوائي	Label	ke info criterion 4.584282 arz criterion 4.675058	Residual ثم	Fitted والقيمة المقدرة Actual
	Log likelihood	Quine ariter. 4.484702	نحدد Actual	البياني لما والبواق Residual التي تحسب
ن البواقي	ئما قبل الحكم أي نموذج فا	^{2.155616} ملاحظة: دا	fitted	التطور الزمني والبواي للمستعمد التي تتعالم
عدمه	J هي أساس قيول النموذح من	Residual	Residual	لسلسلة البواقي من خلال طرح القيمة الحقيقية
	ي ٥٠٠٠ (٤٠٠٠ (٤٠٠٠ (٤٠)		Tahle	من القيمة المقدرة
			1000	
6.5				•
				•







Cancel

0.0091



لاختبار مشكلة الارتباط الذاتي نذهب الى شريط الأدوات الخاص بالنموذج Equation ثم نظغط على View ثم على Residual **Diagnostics** ثم نختار Serial

correlation

LM Test



	Equation: UNTITLE	O Workfile: UN	NTITLED::Untit	led\ 🗖		٢.
	View Proc Object Print	Name Freeze	Estimate Fored	ast Stats Res	ids	
	Breusch-Godfrey Seria Null hypothesis: No se	al Correlation L rial correlation	M Test: at up to 2 lags	:		^
	F-statistic Obs*R-squared	0.072445 0.281620	Prob. F(2,5) Prob. Chi-So	quare(2)	0.9311 0.8687	
t	Test Equation: Dependent Variable: R Method: Least Square: Date: 01/15/25 Time: Sample: 2015 2024 Included observations: Presample missing va	ESID s 23:12 10 lue lagged resi	duals set to z	ero.		
1	Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.	
•	X1 X2 C RESID(-1) RESID(-2)	-0.019701 -0.019364 0.849089 -0.154437 0.095122	0.249691 0.134942 6.735605 0.511147 0.462784	-0.078901 -0.143496 0.126060 -0.302139 0.205544	0.9402 0.8915 0.9046 0.7747 0.8453	
 '(R-squared Adjusted R-squared S.E. of regression Sum squared resid Log likelihood	0.028162 -0.749308 2.473151 30.58238 -19.77858	Mean depen S.D. depend Akaike info c Schwarz cri Hannan-Qui	dent var ent var riterion erion nn criter.	-1.47E-15 1.869896 4.955716 5.107008 4.789748	~







ملاحظة: يمكن استخدام اختبار دارين و اتسن لاختبار مشكلة الارتباط الذاتي للبواقي









الانحدار البسيط والانحدار المتعدد



01- اختبار النموذج: مشكلة الارتباط الذاتي باستخدام اختبار LM

Equation: EQ02 Workfile: UNTIT	LED::Untitled\	<u> </u>	Equation: EQ02 Wo	orkfile: UNTITI	ED::Untitled		
View Proc Object Print Name Freeze	Estimate Forecast Stats Resids		View Proc Object Print	Name Freeze	Estimate Forec	ast Stats Res	ids
Representations Estimation Output Coefficient Labels	M Test: ht up to 2 lags		Dependent Variable: Y Method: Least Squares Date: 01/19/25 Time: Sample: 2015 2024	; 23:25			
Actual Fitted Residual	Prob. F(2,5) 0.9311 Prob. Chi-Square(2) 0.8687		Included observations:	10			
ARMA Structure			Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
Gradients and Derivative Covariance Matrix			X1 X2 C	0.901854 -0.255989 18.87202	0.206035 0.104048 5.289871	4.377193 -2.460294 3.567577	0.0032 0.0434 0.0091
Coefficient Diagnostics Residual Diagnostics Stability Diagnostics	50110 2010.		R-squared Adjusted R-squared S.E. of regression	0.916507 0.892652 2.120263	Mean depend S.D. depend Akaike info c	dent var ent var riterion	21.90000 6.471304 4.584282
Label	rror t-Statistic Prob.		Sum squared resid Log likelihood	31.46860 -19.92141 38.41957	Schwarz crit Hannan-Quii Durbin-Wats	erion nn criter. con stat	4.675058 4.484702 2.155616
X1 -0.0197 X2 -0.01936 C 0.84908 RESID(-1) -0.154437 RESID(-2) 0.095122	-0.078901 0.9402 -0.143496 0.8915 0.126060 0.9046 0.302139 0.7747 205544 0.8453		Prob(F-statistic)	0.000168	Dubin-wats		2.133010
R-squared0.028162Adjusted R-squared-0.749308S.E. of regression2.473151Sum squared resid30.58238Log likelihood-19.77858	-1.47E-15 1.869896 4.955716 5.107008 4.789748	~					



اذا اردنا العودة من Serial correlation LM Test

من نافذة الاختبار نذهب إلى VIEW نظغط على Estimation Output



الانحدار البسيط والانحدار المتعدد

01- اختبار النموذج: مشكلة الارتباط الذاتي باستخدام اختبار Durbin-Watson stat

Equation: EQ02 Wo	orkfile: UNTITL	.ED::Untitled\					
View Proc Object Print	Name Freeze	Estimate Forec	ast Stats Res	ids			
Dependent Variable: Y Method: Least Squares Date: 01/19/25 Time: Sample: 2015 2024 Included observations:	; 23:25 10						
Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.			
X1 X2 C	0.901854 -0.255989 18.87202	0.206035 0.104048 5.289871	4.377193 -2.460294 3.567577	0.0032 0.0434 0.0091			
R-squared Adjusted R-squared S.E. of regression Sum squared resid Log likelihood F-statistic Prob(F-statistic)	0.916507 0.892652 2.120263 31.46860 -19.92141 38.41957 0.000168	Mean depen S.D. depend Akaike info c Schwarz crit Hannan-Quit Durbin-Wats	dent var ent var riterion terion nn criter. son stat	21.90000 6.471304 4.584282 4.675058 4.484702 2.155616			
Prob(F-statistic) 0.000168 يمكن استخدام اختبار داربن و اتسن لاختبار مشكلة الارتباط الذاتي للبواقي وذلك بالاستعانة بجدول داربن و اتسن							







الانحدار البسيط والانحدار المتعدد

01- اختبار النموذج: مشكلة الارتباط الذاتي باستخدام اختبار Durbin-Watson stat

العمود الأول خاص بعدد المشاهدات

في جدول داربن و اتسن لدين k ونقصد بها عدد المتغيرا المستقلة أما dL و du نقصد بهم القيم التي تحدد المجال الخاص بقيم داربن و اتسن وهو محصور

بين 0 و 4 وهو متناضر عند 2 حيث أن قيمه تكون بالترتيب

إذا كانت قانت قيمة dw في المجال من 0 إلى du معناه وجود مشكلة الارتباط الخطي

إذا كانت قانت قيمة dw في المجال من du حتى dL تسمى منطقة الشك

إذا كانت قانت قيمة dw في المجال من dl حتى 2 تسمى منطقة عدم وجود مشكلة الارتباط الخطي

إذا كانت كانت قيمة dw في المجال من 2 حتى (du-4) منطقة عدم وجود مشكلة الارتباط الخطي

إذا كانت كانت قيمة dw في المجال من (4-du) حتى (4 - dL) منطقة الشك

إذا كانت كانت قيمة dw في المجال من (dL -4) حتى 4 منطقة وجود مشكلة الارتباط الخطي







2- اختبار النموذج: اختبار التوزيع الطبيعي، من شروط قبول النموذج هو ان تتبع البواقي التوزيع الطبيعي



ثم نختار Diagnostics Histogram- Normality Test التفرطح والالعراف المعياري الا أننا تهنم بنتيجة الالملفلس ان كانت أقل من 5بالمائة وهنا نجد أن 0,05 نقول ان البواقي تتبع التوزيع الطبيعي والعكس ان كانت أقل من 5بالمائة وهنا نجد أن القيمة الاحتمالية هي 0,312952 وبالتالي فالبواقي تتبع الوزيع الطبيعي

-03

		_					
Equation: UNTITLED Workfile: UNTITLED::Untitled			Equation: UNTITLED	Workfile: Ul Name Freeze	NTITLED::Untit Estimate Forec	led\ 📃	ids
View Proc Object Print Name Freeze Estimate Forecast Representations Estimation Output Coefficient Labels	Stats Resids		Dependent Variable: Y Method: Least Squares Date: 01/15/25 Time: 2 Sample: 2015 2024 Included observations: 1	23:20			
Actual Fitted Decidual			Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
ARMA Structure	Residuals		X1 X2 C	0.901854 -0.255989 18.87202	0.206035 0.104048 5.289871	4.377193 -2.460294 3.567577	0.0032 0.0434 0.0091
Covariance Matrix	Sam, a24 Observativ		R-squared Adjusted R-squared S.E. of regression	0.916507 0.892652 2.120263	Mean depend S.D. depend Akaike info c	dent var ent var riterion	21.90000 6.471304 4.584282
Coefficient Diagnostics Residual Diagnostics Stability Diagnostics	Mean -1.47e-15 Median -0.471618 Maximum 4.250847 Minimum -1.945444		squared resid	31.46860 -19.92141 38.41957 0.000168	Schwarz crit Hannan-Quir Durbin-Wats	erion nn criter. on stat	4.675058 4.484702 2.155616
Label	Std. Dev. 1.869896 Skewness 1.135368		البواقي الى نافذة	الخاص با	ن الرسم ا	العودة م	ذا اردنا ا
0 -2 -1 0 1 2 3 4 5	Kurtosis 3.648033 Jarque-Bera 2.323411 Probability 0.312952		يذة الرسم ثم Estim	VI في ناف ation O	ة إلى EW ملى utput	ج نذهب نظغط ع	النموذ





He He Ja

03- اختبار النموذج: مشكلة اختلاف التباين

لاختبار مشكلة اختلاف التباين نذهب الى شريط الأدوات الخاص بالنموذج Equation ثم نظغط على View ثم على Residual **Diagnostics** ثم نختار Serial Heteroskedasti

city Test

Service .











-03

at Specification ar Lest type: Breusch-Pagan-Godfrey Dependent variable: RESID^2	Prob F اکبر مر
Breusch-Pagan-Godfrey Dependent variable: RESID^2	
= Glejser The ARCH Test regresses the squared F-statistic 0.423200 Prob. F(1,7) 0.5361	5 بالمائه قان النبية حيثا بين
ARCH White Custom 1 Wizard residuals on lagged squared residuals and a constant. Obs*R-squared 0.513094 Prob. Chi-Square(1) 0.4/38	التمودج يحلوم مشكلة اختلاف
نا كما قلنا سابقا انه يمكن تطبيق أي اختبار، السابقا انه يمكن تطبيق أي اختبار،	التباين وهنا
$\frac{1}{2}$ $ARCH$ وبعد التاكد من عدم وجود مشكلة اختلاف $\frac{1}{2}$ نختار هنا اختبار $0,5$	نجدها 0,5361 مرالتال النومذ
كري المسببة لدرجة الناخير يحتارة المتخدامة في عملية المسببة لدرجة الناخير يحتارة المعالية ا	وبالناي الممود
اين التنبؤوهذا ما سيتم التطرق له OK Cancel	اختلاف التبايز



