

الجامعة المستنصرية

كلية الادارة والاقتصاد

قسم الاحصاء

دراسة مقارنة في طرائق تقدير انحدار التكامل المشترك مع تطبيق عملي

رسالة مقدمة الى

مجلس كلية الادارة والاقتصاد في الجامعة المستنصرية

كجزء من متطلبات نيل درجة الماجستير علوم في الاحصاء

من قبل

أنسام خالد حسن الجبوري

ياشرف

الأستاذ الدكتور

كنعان عبداللطيف عبد الرزاق

ميلادي

الملخص تم في هذا البحث مقارنة بين طرائق تقدير انحدار التكامل المشترك حيث تم اختيار اربعة طرائق وهي طريقة المربعات الصغرى الاعتيادية (Ordinary Least Squares Method) وطريقة المربعات الصغرى المعدلة بالكامل (Fully Modified Ordinary Least Square Method) وطريقة انحدار التكامل المشترك القويم (Canonical Cointegrating Regression Method) وطريقة المربعات الصغرى الديناميكية (Dynamic Ordinary Least Square Method) إذ تبين ان جميع نتائج التقدير كانت جيدة ومعول عليها وذلك من خلال اجراء تطبيقين عمليين الاول حول العلاقة بين عرض النقد M1 والرقم القياسي لاسعار المستهلك CPI في العراق وقد تبين ان مقدرات طريقتي المربعات الصغرى الاعتيادية وطريقة المربعات الصغرى الديناميكية هما الافضل والاكفأ اما في التطبيق العملي الثاني فقد تمت دراسة العلاقة بين عرض النقد M1 والنتائج المحلي الاجمالي GDP في اليابان وقد بينت النتائج ان طريقة المربعات الصغرى الديناميكية هي الافضل. تحليل البيانات واستخراج النتائج تم من خلال استخدام البرنامج الجاهز EViews.7

A Comparative Study in Methods of Estimating Cointegration Regression with Practical Application

A Thesis Submitted

To

The Council of the College of Administration and Economics

Mustansiriya University

As Partial Fulfillment of the Requirements for the Degree of

Master of Science

In

Statistics

By

Ansam Khalid Hassan Al-Jubouri

Supervised By

Prof.Dr.

Kanan Abdul Latif Abdul Razzaq

Abstract

In this research a comparison between the methods of estimating Cointegration regression was chosen as the four methods: Ordinary Least Square Method, Fully Modified Ordinary Least Square Method, Canonical Cointegrating regression Method and Dynamic Ordinary Least Square Method. It was Found that all the results of the estimation was a good and Reliable , through a two applications practical first about the relationship between money supply M1 and the index of consumer prices CPI in Iraq shows that the estimators of the two methods Ordinary Least Square and Dynamic Least Square are the best and most efficient either in the second practical application been studying the relationships between money supply M1 and GDP in Japan has shown results that the method of Dynamic Least Square is the best. Data analysis and results were extracted through the use of software EVIEWS.7 .