

آزمون ریشه واحد برای بررسی مانایی داده های پانلی

A-۱۰-۶۴۶

مژگان نورافشان - هادی جبّاری نوقابی

دانشگاه فردوسی مشهد

چکیده: یکی از مشکلات اساسی تحقیقات، در نظر نگرفتن مانایی متغیرها یا روند تغییرات آنها در زمان به عنوان یک عامل اثر گذار بر تجزیه و تحلیل های رگرسیونی است. از طرفی از خصوصیات مهمی که داده ها باید دارا باشند، مانابودن آنهاست. مانابودن داده ها مانع از ایجاد رگرسیون کاذب میان متغیرها می شود. پس قبل از برآورد مدل، برای اطمینان از ساختگی نبودن و در پی آن داشتن نتایج نامطمئن، لازم است از مانایی متغیرها اطمینان حاصل کنیم. در این تحقیق آزمون های مختلف ریشه واحد، برای بررسی مانایی متغیرها تشریح شده است.

واژه های کلیدی: آزمون های ریشه واحد، داده های پانلی، مانایی