

*Εισαγωγές και προστασία εγχώριας
παραγωγής*

Παράδειγμα 10.5

$$\begin{aligned} \log(\text{Εισαγωγές_Κίνα}(t)) = & -17.8 + 3.12\log(\text{Παρ.}_\text{Χημικών}(t)) \\ & (21.05) \quad (0.48) \\ & +.196\log(\text{Παρ.}_\text{Βενζίνης}(t)) + .983\log(\$ (t)) \\ & (.907) \qquad \qquad \qquad (.400) \\ & +.060(\text{Πριν}_\text{Κατάθεση}(t)) - .032(\text{Κατάθεση}(t)) \\ & (.261) \qquad \qquad \qquad (.264) \\ & -.566(\text{Μετά}(t)) \\ & (.286) \end{aligned}$$

$n = 131$, $R^2 = 0.305$, $\bar{R}^2 = 0.271$ (Φεβ. '78-Δεκ. '88)

$$\text{Κατάθεση}(t) = \begin{cases} 1 & \text{για } t \in [\underline{\text{Οκτ. '83}}, \text{Μαρ. '84}] \\ 0 & \end{cases}$$

$$\text{Πριν_Κατάθεση}(t) = \begin{cases} 1 & \text{για } t \in [\text{Μαρ. '83}, \text{Σεπ. '83}] \\ 0 & \end{cases}$$

$$\text{Μετά}(t) = \begin{cases} 1 & \text{για } t \in [\underline{\text{Οκτ. '84}}, \text{Μαρ. '85}] \\ 0 & \end{cases}$$

• $\text{Κατάθεση}(t) \implies$ Ασήμαντη

• $\text{Πριν_Κατάθεση}(t) \implies$ Ασήμαντη

• $\text{Μετά}(t) \implies$ Στατιστικά σημαντική.

Οικονομική σημασία:

Μεταβολή κατά $100[\exp(-.566)-1]$

$\cong -43.2\%$

Π.χ. 12.3 (10.5) – Έλεγχος για αυτοσυσχέτιση 3ου βαθμού

$$\log(\text{Εισαγωγές_Κίνα}(t)) = -17.8 + 3.12\log(\text{Παραγωγή}(t))$$

(21.05) (0.48)

$$n = 131,$$

$$R^2 = 0.305, \quad +.196\log(\text{Παρ.}_\text{Βενζίνης}(t)) + .983\log(\$ (t))$$

(.907) (0.400)

$$\bar{R}^2 = 0.271$$

$$+ .060(\text{Πριν_Κατάθεση}(t)) - .032(\text{Κατάθεση}(t))$$

(Φεβ. '78-Δεκ. '88) (0.261) (0.264)

$$- .566(\text{Μετά}(t))$$

(0.286)

Παλινδρομούμε:

$$\hat{u}_t = \gamma' x_t + \rho_1 \hat{u}_{t-1} + \rho_2 \hat{u}_{t-2} + \rho_3 \hat{u}_{t-3} + \zeta_t$$

$$F = 5.12, \beta.ε. = (3, 118) \quad \Rightarrow p = .0023 \quad \Rightarrow \text{Απορρίπτουμε } H_0$$

Παράδειγμα 12.4 (Παράδειγμα 10.5)

$\log(\text{Εισαγωγές_Κίνα}(t)) = -17.8 +$	$3.12\log(\text{Παραγωγή}(t))$
(21.05)	(0.48)
-37.31 (23.33)	2.95 (0.65)
(Φεβ. '78-Δεκ. '88)	$+ .196\log(\text{Παρ._Βενζίνης}(t)) + .983\log(\$ (t))$
$n = 131,$	$(.907)$ $(.400)$
$R^2 = 0.305,$	1.05 (0.99) 1.14 (0.51)
CO: $\rho^{\wedge} = .293 (.084)$	$+ .060(\text{Πριν_Κατάθεση}(t)) - .032(\text{Κατάθεση}(t))$
n=130	$(.261)$ $(.264)$
$R^2 = 0.193 (?)$	-.016 (.321) -.033 (.323)
Παρόμοιες	$-.565(\text{Μετά}(t))$
εκτιμήσεις	$(.286)$
Ψηλότερες Τ.Α.	-.577 (.343)