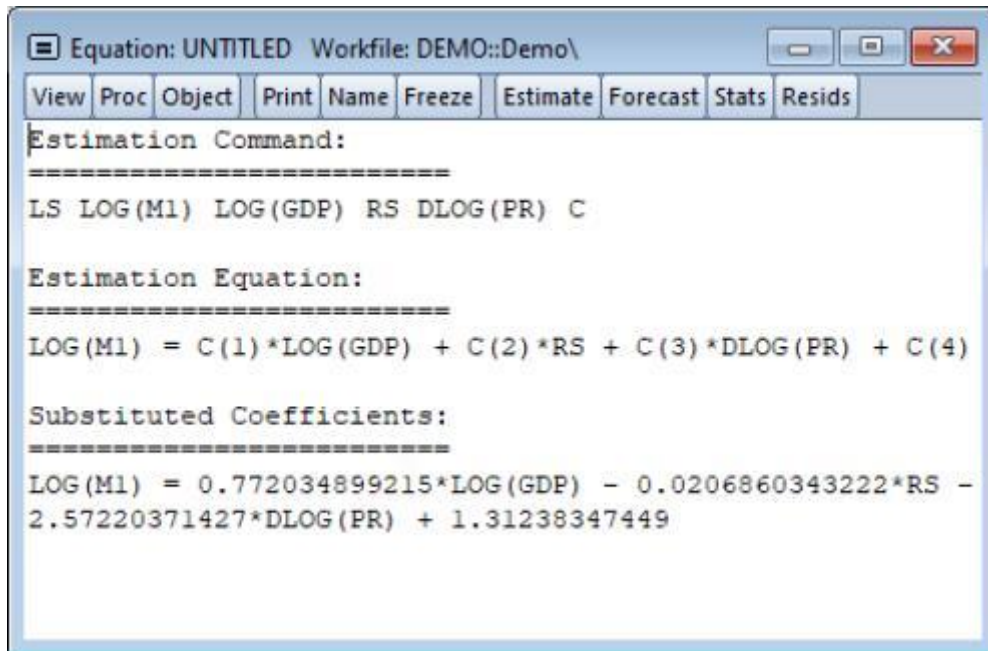


EViews 演示-规范和假设检验

我们可以使用估计的方程对模型的系数进行假设检验。例如，为了检验价格项的系数等于 2 的假设，我们将执行 Wald 检验。首先，通过从方程工具栏中选择 **View/Representations** 来确定感兴趣的系数：



请注意，系数是按照变量在规范中出现的顺序分配的，因此 PR 项的系数被标记为 C(4)。要测试对 C(4) 的限制，您应该选择

View/Coefficient Diagnostics/Wald Test-Coefficient Restrictions...，然后输入限制“c(4)=2”。EViews 将报告 Wald 检验的结果：

Wald Test:
Equation: UNITITLED
Null Hypothesis: $C(4)=2$

Test Statistic	Value	df	Probability
t-statistic	-4.850856	159	0.0000
F-statistic	23.53081	(1, 159)	0.0000
Chi-square	23.53081	1	0.0000

Null Hypothesis Summary:

Normalized Restriction (= 0)	Value	Std. Err.
$-2 + C(4)$	-4.572204	0.942556

Restrictions are linear in coefficients.

低概率值表明 $C(4)=2$ 的原假设被强烈拒绝。

然而，我们应该有些谨慎，不要在不进行进一步分析的情况下接受这一结果。上面报告的 Durbin-Watson 统计量的低值表明估计方程的残差中存在序列相关性。如果不进行校正，残差中的序列相关将导致对标准误差的错误估计，以及对方程系数的无效统计推断。

Durbin-Watson 统计数据可能难以解释。要对残差中的序列相关执行更一般的 Breusch-Godfrey 检验，请从方程工具栏中选择

View/Residual Diagnostics/Serial Correlation LM Test...，并指定要检验的序列相关顺序。输入“1”产生针对一阶序列相关性的检验：

Breusch-Godfrey Serial Correlation LM Test:

F-statistic	813.0060	Prob. F(1,158)	0.0000
Obs*R-squared	136.4770	Prob. Chi-Square(1)	0.0000

Test Equation:

Dependent Variable: RESID

Method: Least Squares

Date: 08/18/09 Time: 14:10

Sample: 1952Q2 1992Q4

Included observations: 163

Presample missing value lagged residuals set to zero.

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	-0.006355	0.013031	-0.487683	0.6265
LOG(GDP)	0.000997	0.002645	0.376929	0.7067
RS	-0.000567	0.001018	-0.556748	0.5785
DLOG(PR)	0.404143	0.381676	1.058864	0.2913
RESID(-1)	0.920306	0.032276	28.51326	0.0000
R-squared	0.837282	Mean dependent var	1.23E -15	
Adjusted R-squared	0.833163	S.D. dependent var	0.054969	
S.E. of regression	0.022452	Akaike info criterion	-4.724644	
Sum squared resid	0.079649	Schwarz criterion	-4.629744	
Log likelihood	390.0585	Hannan-Quinn criter.	-4.686116	
F-statistic	203.2515	Durbin-Watson stat	1.770965	
Prob(F-statistic)	0.000000			

输出的顶部显示检验统计量和相关的概率值。用于执行检验的测试回归报告在统计数据下方。

标记为“Obs*R-squared”的统计量是无序列相关的原假设的 LM 检验统计量。（有效）零概率值强烈表明残差中存在序列相关性。