

EViews 演示-其他检验

请注意，选择上述规范仅用于说明目的。事实上，在 EQLAGS 上执行各种规范测试表明现有规范可能存在许多问题。

首先，即使在估计滞后规范之后，仍然存在相当多的 serial 相关性。EQLAGS 方程中的序列相关性检验（通过选择 **View/Residual Diagnostics/Serial Correlation LM Test...**，然后输入“1”表示滞后数）否定了重新制定的方程中没有序列相关的原假设。输出的顶部是：

Breusch-Godfrey Serial Correlation LM Test:

F-statistic	7.880369	Prob. F(1,153)	0.0056
Obs*R-squared	7.935212	Prob. Chi-Square(1)	0.0048

此外，残差中存在自回归条件异质性（ARCH）的有力证据。选择 **View/Residual Diagnostics/Heteroskedasticity Tests...** 以显示 **Heteroskedasticity Tests** 对话框。然后从列表框中选择 **ARCH** 并接受默认值“1”。ARCH 测试结果的顶部显示，数据表明残差中存在 ARCH：

Heteroskedasticity Test: ARCH

F-statistic	11.21965	Prob. F(1,159)	0.0010
Obs*R-squared	10.61196	Prob. Chi-Square(1)	0.0011

除了 serial 相关和 ARCH 之外，上述规范还有一个更根本的问题，因为正如图形所证明的那样，LOG（M1）表现出明显的上升趋势，这表明我们应该在这个序列中执行一个单位根。单位根的存在将表明需要进一步分析。

我们再次显示 LOG（M1）序列窗口，方法是单击 **Window**，然后从菜单中选择 LOG（M1）序列窗口。如果 LOG（M1）的序列窗口不存在（如果您之前关闭了该窗口），则可以通过选择 **Quick/Show...**，输入“log（m1）”，然后单击 OK 来再次打开新窗口。

在计算检验统计量之前，我们将通过单击 **Quick/Sample...**，然后在对话框中输入“@all”，将工作文件样本重置为所有观测值...，。

接下来，要对此序列的不稳定性执行增强 Dickey-Fuller（ADF）测试，请选择 **View/Unit Root Test...**，然后单击 OK 以接受默认选项。

EViews 将执行 ADF 测试并显示测试结果。输出的顶部显示为：

Null Hypothesis: LOG(M1) has a unit root
Exogenous: Constant
Lag Length: 0 (Automatic - based on SIC, maxlag=13)

	t-Statistic	Prob.*
Augmented Dickey-Fuller test statistic	3.797182	1.0000
Test critical values:		
1% level	-3.470679	
5% level	-2.879155	
10% level	-2.576241	

*MacKinnon (1996) one-sided p-values.

EViews 使用自动选择确定的测试方程中滞后差项的数量（此处为 4 个）执行 ADF 测试统计。ADF 检验统计量值的概率值为 0.9911，几乎没有证据表明我们可以否定单位根的原假设。

如果我们的数据中存在单位根，我们可能希望采用更复杂的统计模型。这些技术在[“时间序列回归”](#)，[“向量自回归（VAR）模型”](#)中讨论，它们分别处理基本时间序列，协整回归模型和向量纠错规范）。