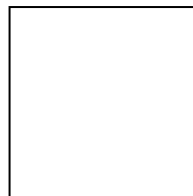


作業（六）：異質變異與自我相關

繳交日期：2006年1月2日

班別：\_\_\_\_\_ 學號：\_\_\_\_\_ 姓名：\_\_\_\_\_ 成績：\_\_\_\_\_



一

B-P 值 = 0.4014 而卡方值為 9.487729。B-P 值小於卡方值，所以不拒絕虛無假設  $H_0$ ：變異數具有齊一性。因此，本題沒有異質變異的特性。

二

1.  $M_t = \beta_1 + \beta_2 E_t + \beta_3 S_t + e$  其中私部門就業總數為 ( $E_t$ )，平均每人每月實質現金給予總額為 ( $S_t$ )，日本防衛關係費為 ( $M_t$ )

2.  $M_t = -75944.18702 + 16.62947942E_t + 0.04950480382S_t + R^2$   
 (-25.662) (13.026) (3.525) (t)

3. 根據上題的結果顯示，就業數以及現金給予總額總額都會對防衛關係費造成影響。且兩者均成現正相關。(由 t 值可以得知)

4. JB 值 2.843445 小於卡方值 7.814725，所以不拒絕虛無假設  $H_0$ ：殘差為常態分配。因此，可以得出殘差為常態分配的結論。

5. 有自我相關，因為在 LM 的檢定中，RESID1 (代表前一期的誤差) 會影響的原先的模型。因此，才對模型進行修正。修正結果如下：

Variable	Coefficient	Standard Error	b/St. Er.	P[ Z >z]	Mean of X
Constant	-71490.19684	5566.9604	-12.842	.0000	
ET	14.94604303	1.8333665	8.152	.0000	5678.3000
ST	.6411236762E-01	.18036402E-01	3.555	.0004	361343.27
RHO	.6516674166	.14085081	4.627	.0000	