

لازم به ذکر است که اگرچه یکی از مزایای مدل ARDL بکارگیری متغیرها با درجه پایایی متفاوت است، اما به منظور بررسی عدم وجود متغیر I(2) در این مطالعه از آزمون دیکی فولر تعمیم یافته^۱ (ADF) درجه پایایی آن‌ها آزمون شده است. فرض صفر این آزمون مبنی بر وجود ریشه واحد متغیر است. نتایج آزمون نشان می‌دهد که متغیرهای مدل I(0) و I(1) هستند. لذا مدل ARDL مدل مناسبی برای تحلیل و بررسی رابطه بین آن‌ها می‌باشد.

۴-۱. مدل متقارن

به عنوان یک معیار، ابتدا مدل ARDL خطی معادله (۵) با استفاده از روش OLS خطی (پس از تعیین وقفه بهینه با معیار شوارتز) تخمین زده شده است. سپس همبستگی بین متغیرها با استفاده از آزمون F پسران و همکاران (۲۰۰۱) یا آزمون t بنرجی و همکاران (۱۹۹۸) بررسی شده است. جداول ۳ و ۴ به ترتیب نتایج برآورد کوتاه‌مدت و بلندمدت مدل خطی را نشان می‌دهد. نتایج به دست آمده وجود همبستگی بین متغیرها را نشان می‌دهد. لذا به بررسی و تحلیل اثرات کوتاه‌مدت و بلندمدت قیمت نفت و نرخ بهره بر نرخ بیکاری در ایران می‌پردازیم. در این مدل در کوتاه‌مدت اثرات تغییرات قیمت نفت بر نرخ بیکاری معنادار نیست اما در بلندمدت هر دو متغیر نرخ بهره و قیمت نفت بر نرخ بیکاری اثرگذارند. آماره ضریب لاگرانژ (LM) و آزمون رمزی (RESET) در آزمون‌های تشخیصی، بیانگر خوبی مدل و عدم وجود خودهمبستگی سریالی بین متغیرهاست.

جدول ۲. ضرایب کوتاه‌مدت مدل خطی

متغیر	ضریب	آماره t	احتمال
UR(-1)	۰٫۸۹	۴٫۱۸	۰٫۰۰
UR(-2)	-۰٫۳۹	-۲٫۴۴	۰٫۰۲
IR	-۰٫۱۷	-۱٫۹۰	۰٫۰۶
OP	۰٫۰۱	۱٫۶۶	۰٫۱۰
C	۸٫۴۲	۳٫۰۱	۰٫۰۰

منبع: یافته‌های تحقیق