Procédure REG
Modèle : MODEL1
Variable dépendante : rate

Nombre d'observations lues	428
Nombre d'observations utilisées	428

Analyse de variance					
Source	**DDL**	**Somme des carrés**	**Moyenne quadratique**	**Valeur F**	**Pr > F**
Modèle	3	720.59418	240.19806	39.02	<.0001
Erreur	424	2609.92695	6.15549		
Total sommes corrigées	427	3330.52112			

Root MSE	2.48103	**R carré**	0.2164
Moyenne dépendante	6.14576	**R car. ajust.**	0.2108
Coeff Var	40.36969		

Valeurs estimées des paramètres					
Variable	**DDL**	**Valeur estimée des paramètres**	**Erreur type**	**Valeur du test t**	**Pr > |t|**
Intercept	1	1.21408	0.55169	2.20	0.0283
ip	1	0.04835	0.00550	8.79	<.0001
gm2	1	140.32613	36.03850	3.89	0.0001
gpwlag	1	104.58845	17.44218	6.00	<.0001

The AUTOREG Procedure

Dependent Variable	rate

Ordinary Least Squares Estimates			
SSE	2609.92695	**DFE**	424
MSE	6.15549	**Root MSE**	2.48103
SBC	2012.65232	**AIC**	1996.41583
MAE	1.82390001	**AICC**	1996.51039
MAPE	33.1257817	**HQC**	2002.82835
Durbin-Watson	0.1837	**Regress R-Square**	0.2164
		Total R-Square	0.2164

Valeurs estimées des paramètres					
Variable	**DDL**	**Valeur estimée**	**Erreur type**	**Valeur du test t**	**Approx. de Pr > |t|**
Intercept	1	1.2141	0.5517	2.20	0.0283
ip	1	0.0484	0.005503	8.79	<.0001
gm2	1	140.3261	36.0385	3.89	0.0001
gpwlag	1	104.5884	17.4422	6.00	<.0001

Covariance des valeurs estimées du paramètre				
	Intercept	**ip**	**gm2**	**gpwlag**
Intercept	0.3043641	-0.002729	-12.69598	-0.890039
ip	-0.002729	0.0000303	0.0644415	-0.002859
gm2	-12.69598	0.0644415	1298.7734	20.976285
gpwlag	-0.890039	-0.002859	20.976285	304.22962

Estimations des autocorrélations			
Retard	**Covariance**	**Corrélation**	-1 9 8 7 6 5 4 3 2 1 0 1 2 3 4 5 6 7 8 9 1
0	6.0980	1.000000	| |********************|
1	5.5289	0.906683	| |****************** |

Preliminary MSE	1.0850

The AUTOREG Procedure

Estimations des paramètres autorégressifs			
Retard	**Coefficient**	**Erreur type**	**Valeur du test t**
1	-0.906683	0.020509	-44.21

The AUTOREG Procedure

Yule-Walker Estimates			
SSE	128.07451	**DFE**	423
MSE	0.30278	**Root MSE**	0.55025
SBC	730.246684	**AIC**	709.951068
MAE	0.34580645	**AICC**	710.093248
MAPE	5.7620059	**HQC**	717.966719
Durbin-Watson	1.2238	**Regress R-Square**	0.1273
		Total R-Square	0.9615

Valeurs estimées des paramètres					
Variable	**DDL**	**Valeur estimée**	**Erreur type**	**Valeur du test t**	**Approx. de Pr > |t|**
Intercept	1	2.6693	0.9215	2.90	0.0040
ip	1	0.0481	0.0112	4.31	<.0001
gm2	1	-62.6221	10.8790	-5.76	<.0001
gpwlag	1	7.6919	3.4184	2.25	0.0250

Covariance des valeurs estimées du paramètre				
	Intercept	**ip**	**gm2**	**gpwlag**
Intercept	0.8490701	-0.009788	-1.194169	-0.012117
ip	-0.009788	0.0001249	0.0064848	-0.000481
gm2	-1.194169	0.0064848	118.35158	2.3162903
gpwlag	-0.012117	-0.000481	2.3162903	11.685329

The AUTOREG Procedure

Dependent Variable	rate

Ordinary Least Squares Estimates			
SSE	2609.92695	**DFE**	424
MSE	6.15549	**Root MSE**	2.48103
SBC	2012.65232	**AIC**	1996.41583
MAE	1.82390001	**AICC**	1996.51039
MAPE	33.1257817	**HQC**	2002.82835
Durbin-Watson	0.1837	**Regress R-Square**	0.2164
		Total R-Square	0.2164

Valeurs estimées des paramètres					
Variable	**DDL**	**Valeur estimée**	**Erreur type**	**Valeur du test t**	**Approx. de Pr > |t|**
Intercept	1	1.2141	0.5517	2.20	0.0283
ip	1	0.0484	0.005503	8.79	<.0001
gm2	1	140.3261	36.0385	3.89	0.0001
gpwlag	1	104.5884	17.4422	6.00	<.0001

Covariance des valeurs estimées du paramètre				
	Intercept	**ip**	**gm2**	**gpwlag**
Intercept	0.3043641	-0.002729	-12.69598	-0.890039
ip	-0.002729	0.0000303	0.0644415	-0.002859
gm2	-12.69598	0.0644415	1298.7734	20.976285
gpwlag	-0.890039	-0.002859	20.976285	304.22962

Estimations des autocorrélations			
Retard	**Covariance**	**Corrélation**	-1 9 8 7 6 5 4 3 2 1 0 1 2 3 4 5 6 7 8 9 1
0	6.0980	1.000000	| |********************|
1	5.5289	0.906683	| |****************** |

Preliminary MSE	1.0850

The AUTOREG Procedure

Estimations des paramètres autorégressifs			
Retard	**Coefficient**	**Erreur type**	**Valeur du test t**
1	-0.906683	0.020509	-44.21

Algorithm converged.

The AUTOREG Procedure

Maximum Likelihood Estimates			
SSE	106.42486	**DFE**	423
MSE	0.25160	**Root MSE**	0.50159
SBC	654.452947	**AIC**	634.157331
MAE	0.31086055	**AICC**	634.299511
MAPE	4.98618734	**HQC**	642.172982
Log Likelihood	-312.07867	**Regress R-Square**	0.1765
Durbin-Watson	1.4486	**Total R-Square**	0.9680
		Observations	428

Valeurs estimées des paramètres					
Variable	**DDL**	**Valeur estimée**	**Erreur type**	**Valeur du test t**	**Approx. de Pr > |t|**
Intercept	1	-11.3909	8.6408	-1.32	0.1881
ip	1	0.2131	0.0396	5.38	<.0001
gm2	1	-63.2056	9.5629	-6.61	<.0001
gpwlag	1	6.3606	2.9846	2.13	0.0336
AR1	1	-0.9972	0.005017	-198.78	<.0001

Covariance des valeurs estimées du paramètre					
	Intercept	**ip**	**gm2**	**gpwlag**	**AR1**
Intercept	74.664239	-0.193599	-4.310196	0.5500313	0.0307718
ip	-0.193599	0.0015679	0.0304176	-0.005384	-0.000068
gm2	-4.310196	0.0304176	91.44845	1.7011144	-0.001467
gpwlag	0.5500313	-0.005384	1.7011144	8.9075565	0.0001368
AR1	0.0307718	-0.000068	-0.001467	0.0001368	0.0000252

Paramètres autorégressifs supposés					
Variable	**DDL**	**Valeur estimée**	**Erreur type**	**Valeur du test t**	**Approx. de Pr > |t|**
Intercept	1	-11.3909	6.0858	-1.87	0.0619
ip	1	0.2131	0.0372	5.72	<.0001
gm2	1	-63.2056	9.5584	-6.61	<.0001
gpwlag	1	6.3606	2.9844	2.13	0.0336

The AUTOREG Procedure

Covariance des valeurs estimées du paramètre				
	Intercept	**ip**	**gm2**	**gpwlag**
Intercept	37.037028	-0.110956	-2.516187	0.3827855
ip	-0.110956	0.0013864	0.0264773	-0.005017
gm2	-2.516187	0.0264773	91.362915	1.7090884
gpwlag	0.3827855	-0.005017	1.7090884	8.9068132