|  |  |
| --- | --- |
| **كلية الادارة والاقتصاد** | College Name |
| **احصاء**  | Department |
| **مهدي محمد البياع** | Full Name as written in Passport |
|  | e-mail |
|  **Professor**  |  **Assistant Professor** |  **Lecturer** |  **Assistant Lecturer**  | Career  |
|  PhD  |  Master  |  |
| **استخدام أساليب التمهيد المويجية في تشخيص بعض من نماذج السلاسل الزمنية اللاخطية باستخدام المحاكاة** | Thesis Title  |
| **1429 هجري**  **2008 ميلادي** | Year |
| **أن بناء النماذج في السلاسل الزمنية يتطلب عدداً من الخطوات المهمة والمكملة لبعضها البعض ويعد التشخيص (Identification) أولى هذه الخطوات وأهمها لأنها تشكل الأساس في تحديد نوع الأنموذج ورتبته، هذا ويعد تشخيص نماذج السلاسل الزمنية اللاخطية من أصعب الأمور التي قد تواجه الباحثين في مجال السلاسل الزمنية وقد انحصرت لوقتٍ طويلٍ من الزمن في عددٍ محدد من النماذج اللاخطية وبالرتب الدنيا منها فقط.****وبتطور أساليب المعالجات الإحصائية ظهرت في منتصف الثمانينات من القرن المنصرم فكرة التحويلات المويجية ولم تستخدم هذه التحويلات في السلاسل الزمنية إلا في بداية هذا القرن وقد انحصرت غالبيتها العظمى في تشخيص النماذج الخطية غير المستقرة حصراً وتعد هذه الأطروحة واحدة من الأطاريح والتي تناولت استخدام مرشحات التمهيد المويجية في تشخيص نماذج السلاسل الزمنية اللاخطية وذلك من خلال طريقة لامعلمية يمكن من خلالها تشخيص أي أنموذج سلاسل زمنية لاخطية وأياً تكن رتبته.****كما أقترح الباحث أنموذجاً لاخطياً مقترحاً يقوم على استخدام نوع جديد من أنواع العتبة وهي العتبة العاموديه بدلاً من نماذج العتبة الأفقية المستخدمة سابقاً ودمج فكرة هذا الأنموذج مع نماذج السلاسل الزمنية الثنائية الخطية القطرية الصافية ليظهر أنموذج السلاسل الزمنية الثنائية الخطية القطرية الصافية ذات العتبة العاموديه DPBL –VT.****ومن خلال استخدام أسلوب المحاكاة تمت البرهنة على كفاءة استخدام مرشحات التمهيد المويجية في تشخيص عدد من النماذج اللاخطية مثل نماذج السلاسل الزمنية الثنائية الخطية القطرية الصافية DPBL ونماذج الانحدار الذاتي بمعالم متغيرة زمنياً RC-AR ونماذج المتوسطات المتحركة بمعالم متغيرة زمنياً RC-MA بالإضافة طبعاً للأنموذج المقترح وذلك من خلال عدد من حجوم العينات وباستخدام دالةDaubechies المويجية تم اختيار عدد من المرشحات في كل تجربة.**  |  Abstract  |