|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **كلية الادارة والاقتصاد** | | | | College Name |
| **احصاء** | | | | Department |
| **وفاء عدنان ساجد** | | | | Full Name as written in Passport |
|  | | | | e-mail |
| **Professor** | **Assistant Professor** | **Lecturer** | **Assistant Lecturer** | Career |
| PhD | | Master | |  |
| دراسة حصول حصانة معيار بارزن | | | | Thesis Title |
| 2008م | | | | Year |
| **اقترح الباحث Parzen معيارا عام (1974) واصطلح على تسميته في الأدبيات العلمية بـ(CAT)(Criterion Auto regressive transfer function) إذ يعتبر هذا المعيار من المعايير المهمة في تحديد درجة الأنموذج الإحصائي. والذي طبق بنجاح في حل مشاكل تحديد درجة الأنموذج للعديد من المواضيع العلمية والعديد من المسائل التطبيقية في العلوم الأخرى منها، تحليل الانحدار، التحليل العاملي، سلاسل ماركوف والسلاسل الزمنية، ونظرا لكون عملية تحديد درجة أنموذج الانحدار الذاتي في السلاسل الزمنية مهمة ومفيدة جدا لعملية بناء الأنموذج باعتبارها أحد المسائل التي تواجه الكثير من الباحثين وخاصة في السلاسل الزمنية. أن سياق العمل بهذا المعيار هو عمل توليفة من النماذج وبدرجات مختلفة من أنموذج الانحدار الذاتي AR(P) والذي يكون أحد هذه النماذج هو الأنموذج الحقيقي للسلسلة الزمنية قيد الدراسة. ومن ثم حساب قيم (CAT)لكل أنموذج فيكون الأنموذج المطلوب هو الذي يعطي اقل قيمة من قيم (CAT). ويتميز هذا المعيار بأنه يمكن استخدامه في السلاسل الزمنية المستقرة وغير المستقرة. لقد أجريت الكثير من البحوث على هذا المعيار بغية تطويره لكي يكون اكثر فاعلية في أغراض التنبؤ. يهدف البحث هذا إلى دراسة حصانة معيار بارزن في تقدير درجة أنموذج الانحدار الذاتي عند خضوع خطأ هذا الأنموذج لتوزيعات معينة ولحالات مختلفة للسلسلة الزمنية وأحجام مختلفة من العينات وذلك باستخدام المحاكاة. حيث تم دراسة هذا المعيار بالاعتماد على أحد عشر توزيعا هي التوزيع الطبيعي المعياري و توزيع كاما و توزيع بواسون وتوزيع ثنائي الحدين و التوزيع الأسى و توزيع كامبل و التوزيع المنتظم المستمر و التوزيع المنتظم المتقطع و توزيع كوشي و توزيع T و التوزيع اللوغارتمي الطبيعي حيث تم التوصل إلى جملة من الاستنتاجات والتوصيات بخصوص ذلك هي التي ستجدونها في هذه الرسالة .** | | | | Abstract |