|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **كلية الادارة والاقتصاد** | | | | College Name |
| **احصاء** | | | | Department |
| **عبيد محمود محسن الزوبعي** | | | | Full Name as written in Passport |
|  | | | | e-mail |
| **Professor** | **Assistant Professor** | **Lecturer** | **Assistant Lecturer** | Career |
| PhD | | Master | |  |
| **تشخيص وفحص مدى الملاءمة لنماذج السلاسل الزمنية المختلطة ذات الرتب الدنيا** | | | | Thesis Title |
| **2005م** | | | | Year |
| **تمثل الهدف ببحث مرحلتي التشخيص Identification وفحص مدى الملاءمة Diagnostic checking للنماذج المختلطة ARMA ذات الرتب الدنيا في مجال الزمن Time Domain وفي مجال التكرار Frequency Domain والمقارنة بين ادوات التشخيص ومعايير اختيار الرتبة واختبارات فحص مدى الملاءمة.**  **اعتمدت منهجية البحث بشكلٍ متوازٍ كلاً من الجانب النظري، (استخدام النظرية الاحصائية) والجانب التجريبي (استخدام المحاكاة).**  **وتضمنت هيكلية البحث خمسة فصول، اضافة الى المقدمة التي شملت هدف البحث والعرض المرجعي للبحوث ذات العلاقة.**  **تضمن الفصل الاول المفاهيم الاساسية لتحليل السلاسل الزمنية والاستقرارية والنماذج المختلطة ذات الرتب الدنيا وادوات التحليل بأتجاهي الزمن والتكرار.**  **وشمل الفصل الثاني مرحلة التشخيص، فتضمن عرض ادوات التشخيص ومعايير اختيار رتبة النماذج، وتضمن اقتراح طريقتين جديدتين للتشخيص ومعياراً جديداً لتحديد الرتبة.**  **أما الفصل الثالث فقد شمل مرحلة فحص مدى الملاءمة من خلال عرض مجموعة من الاختبارات التي تعتمد على الاتجاهين، الزمن والتكرار. كما تضمن عرضاً لبعض الاتجاهات الاخرى في تحليل السلاسل الزمنية، بغية الاشارة الى مسالك اخرى يمكن للباحثين ولوجها.**  **وشمل الفصل الرابع الجانب التجريبي من خلال تطبيق ما عرض في الفصول السابقة على النماذج المختلطة ARMA(0,1), ARMA(1,0), ARMA(1,1)، وايجاد المقارنات بين أدوات التشخيص ومعايير اختيار الرتبة واختبارات مدى الملائمة من خلال اعطاء قيم مختلفة للمعلمات φ1,θ1 ولحجوم مختلفة للسلاسل وبتكرار كل من التجارب (1000) مره.**  **وتم التوصل الى مجموعه من الاستنتاجات والتوصيات تضمن الفصل الخامس ابرزها.**  **وان اهم ما يميز هذا البحث ما يأتي:**  **1- شمل النماذج MA, AR, ARMA (ذات الرتب الدنيا) دون ان تفقده هذه الشمولية التعمق في تحقيق اهداف البحث, في حين ان اغلب البحوث السابقة اقتصرت على نوع واحد من هذه النماذج.**  **2- شمل مرحلتي التشخيص وفحص مدى الملاءمة وما تتضمنه مرحلة التشخيص من عرض لادوات التشخيص ومعايير اختيار الرتبة للنماذج المدروسة.**  **3- تضمن البحث اقتراح طريقتين جديدتين اضيفتا كأدوات للتشخيص وتحديد الرتبة كما تضمن اقتراح معيار جديد لتحديد رتبة النموذج.**  **4- تضمن البحث عرضاً لبعض الاتجاهات الاخرى في تحليل السلاسل الزمنية بغية الاشارة الى مسالك اخرى يمكن للباحثين ولوجها، اضافة الى ما تمثله من اكتمال للصورة التي يمكن ان تكون عليها الظاهرة المدروسة.**  **5- شمل البحث تغطية اتجاهي الزمن والتكرار في التحليل مع الربط بينهما في اكثر من مكان** | | | | Abstract |