|  |  |
| --- | --- |
| **كلية الادارة والاقتصاد** | College Name |
| **احصاء**  | Department |
| **علي سيـف الديـن عبد الحـافـظ** | Full Name as written in Passport |
|  | e-mail |
|  **Professor**  |  **Assistant Professor** |  **Lecturer** |  **Assistant Lecturer**  | Career  |
|  PhD  |  Master  |  |
| **تقدير نموذج لامعلمي للبيانات الطولية للقطاعات الاقتصادية في العراق**  | Thesis Title  |
| **2012 بغداد 1433**  | Year |
|  **أن نماذج المعاملات المتغيرة زمنياً (Time-varying coefficient models) هي ادوات مهمة جداً لشرح الديناميكية في كثير من العلوم مثل الاقتصادية,المالية,السياسية,علم الاوبئة ...الخ ,أي كيفية تغير معاملات المتغيرات زمنياً , وكذلك أستعمالها هيكل خفي (Hidden Structure) لتجنب مشكلة تعدد الابعاد (Curse of Dimensionality) للنماذج اللامعلميه ففي السنوات العشر الاخيرة, واجهت نماذج المعاملات المتغيرة تطورات عميقة ومثيرة على الجانبين النظري والعملي وخاصة في تطبيقات البيانات الطولية.** **في هذه الاطروحة تم أستعراض بعض التقنيات اللامعلميه لتقدير دوال المعاملات المتغيرة زمنياً للأنموذج الحدي اللامعلمي للبيانات الطولية المتزنة والتي تتصف بكون المشاهدات يتم الحصول عليها من n من القطاعات المستقلة كل واحد منها يقاس تكرارياً خلال مجموعة نقاط زمن محددة m ,وعلى الرغم من أن القياسات هي مستقلة بين القطاعات المختلفة الاّ أنها على الأغلب تكون مرتبطة داخل كل قطاع,والتقنيات المستعملة هي تقنية متعدد الحدود الخطي الموضعي LLPK وتقنية شرائح التمهيد التكعيبية CSS ,ولتجاوز مشكلة تعدد الابعاد والحسابات الكثيفة والجهد البرمجي , تم استعمال طريقة المرحلتين لتقدير دوال المعاملات بأستعمال التقنيتين السابقتين, ولكون طريقة المرحلتين تعتمد بالتقدير على طريقة المربعات الصغرى ols التقليدية, وهي حساسة لوجود الشواذ بالبيانات أو تلوث الخطأ ,لذا تم اقتراح أستعمال بعض الأساليب الحصينة مثل LAD و M واستعمالها في تحصين طريقة المرحلتين تجاه الشواذ او تلوث الخطا ,ويمكن أستعمال أساليب الحصانة في أي مرحلة من المرحلتين أو الاثنين معاً وهذا يعطي مرونة عالية من حيث تطبيق أساليب الحصانة .****وتم صياغة تجارب محاكاة للنماذج المستعملة في هذه الاطروحة والتحقق من أداء الطرائق التقليدية والحصينة ولكلا التقنيتين LLPK و CSS بأستعمال معيارين ولمختلف حجوم العينة ومستويات التباين.** **ومن اهداف الاطروحة المهمة هو ايجاد الديناميكية للبيانات , اي كيفية تغير المعاملات للمتغيرات خلال الزمن لمجموعة بيانات طولية متزنة لتسعة قطاعات اقتصادية في العراق هي *قطاع الزراعة والغابات، قطاع التعدين والمقالع، قطاع الصناعة، قطاع الكهرباء والماء، قطاع البناء والتشييد، قطاع النقل والمواصلات، قطاع تجارة الجملة والمفرد وما شبه، قطاع المال والتأمين وأخيراً قطاع خدمات التنمية الاجتماعية وللفترة (*1990*-*2009*) مصاغة* وفق المعاملات المتغيرة زمنياً للأنموذج الحدي اللامعلمي لدالة انتاج كوب- دوغلاس.****وكانت اهم الاستنتاجات , ان استعمال شرائح التمهيد التكعيبية افضل من استعمال متعدد الحدود الخطي الموضعي (kernel) , وكذلك تقدم الطرائق المقترحة الحصينة على طرائق التقدير التقليدية عند جميع حالات التلوث (Contamination) , أما في الجانب العملي تبين ضُعف تأثير متغير الاستثمارات الرأسمالية على عوائد الحجم ,و كذلك ان الناتج المحلي الاجمالي للقطاعات الاقتصادية يعتمد على متغير حجم العمالة بصورة أساس , وكذلك ان عوائد الحجم للفترة (1990-2008) هي ذات عوائد حجم متناقصة اي ان مضاعفة كل من الأستثمارات الرأسمالية وحجم العمالة قد لا يؤدي الى مضاعفة الناتج المحلي الاجمالي ,عدا عام (2009) ذو عوائد حجم متزايدة اي ان مضاعفة كل من الأستثمارات الرأسمالية وحجم العمالة قد يؤدي الى مضاعفة الناتج المحلي الاجمالي .** |  Abstract  |