



وزارة التعليم العالي والبحث العلمي

الجامعة المستنصرية

كلية الإدارة والاقتصاد

قسم الإحصاء

رسالة مقدمة إلى مجلس كلية الإدارة والاقتصاد / الجامعة المستنصرية

كجزء من متطلبات نيل درجة الماجستير في علوم الإحصاء

من قبل

فاطمة عبد الرحمن الربيعي

بإشراف

أ.م.د. عبد الجبار عبد العزيز

١٤٣٤ هـ

2013م

1434هـ

المستخلص

.....

يعد التنبؤ من الأهداف الرئيسية لتحليل السلسلة الزمنية باستعمال احد نماذج بوكس – جنكنز المشخص تماما لتمثيل بيانات تلك السلسلة ، ولكن غالبا ما تتأثر السلسلة الزمنية بإحداث خارجية (اعتراضية) مثل العطل ، الإضرابات ، والتشريعات والسياسات المتخذة من قبل الدول ، الحروب والحصار الاقتصادي الذي وقع على قطرنا العزيز هذه الإحداث تسمى بـ التدخلات والتي تحصل في مختلف القطاعات الحيوية فتتأثر بها قيم السلسلة عندئذ يحصل تغير كبير في قيمتها فإما تتزايد او تتناقص في الفترة الزمنية لهذه الإحداث وبالتالي تكون عملية تشخيص أنموذج السلسلة الزمنية لهذا المتغير صعبة .

لذا ينبغي البحث عن أسلوب أخر لتحليل بيانات تلك السلسلة والذي يسمى بتحليل التدخل الذي يعد أداة جيدة لبيان تأثير هذه الإحداث على السلسلة . ولقد تضمن البحث جانبان الأول يمثل الأسس النظرية لموضوع تحليل التدخل ومراحل بناء أنموذج التدخل لحالة السلسلة الزمنية التي تتعرض لحدث واحد او عدة أحداث خارجية .

أما الثاني فيتمثل الجانب التطبيقي إذ تم التطبيق لبيانات واقعية في حالة وجود حدث واحد والمتمثلة بإنتاج النفط الخام في العراق من الفترة 1969/1-1988/8 لبيان تأثير الحرب العراقية- الإيرانية . كما تم دراسة إنتاج النفط الخام من الفترة 1969/1-2004/1 باستعمال أنموذج التدخل المتعدد لدراسة تأثير كل من الحرب العراقية – الإيرانية ، دخول العراق الأراضي الكويتية والحصار الاقتصادي المفروض على قطرنا والاحتلال الأمريكي له . وقد أشارت النتائج المستخرجة إن لهذه الأحداث تأثيرات معنوية .