

رفاء عدنان ساجت. دراسة حول حصانة بارزن .(رسالة ماجستير).\_الجامعة المستنصرية  
كلية الادارة والاقتصاد :قسم الاحصاء. ٢٠٠٨.

1- عند خضوع متغير الخطأ لتوزيع كما فان حصانة معيار بارزن لتقدير درجة أنموذج الانحدار الذاتي عالية في حالة كون السلسلة غير مستقرة على أن هذا المعيار حصين كلما قل حجم العينة عند السلسلة الزمنية غير المستقرة ويزداد حصانة كلما كبر حجم العينة بتلك التي تخضع لمسار عشوائي.

2- حصانة تقدير معيار بارزن لدرجة الأنموذج عند خضوع متغير الخطأ لهذا الأنموذج لتوزيع بواسون على أن هذه الحصانة تتضاءل بزيادة حجم العينة وتتزايد كلما ابتعدت قيمة المعلمة عن الصفر.

٣- عند خضوع متغير الخطأ لتوزيع ثنائي الحدين فان معيار بارزن قد عكس حصانة عالية عند حجم العينات الصغيرة علما أن هذه الحصانة تقل عندما تكون  $(\phi)$  سالبة عند عدم الاستقرارية .

٤- عند خضوع متغير الخطأ لأنموذج الانحدار الذاتي للتوزيع الأسى فان معيار بارزن حصين في حالة حجم العينات الصغيرة وتبدأ بالتناقص كلما كبر حجم العينة .

٥- عند خضوع الخطأ لأنموذج الانحدار الذاتي لتوزيع كامل فان حصانة معيار بارزن تزداد عند كون السلاسل الزمنية غير المستقرة وتزداد كلما كبر حجم العينة والعكس صحيح بالنسبة للسلاسل الزمنية المستقرة وعند خضوع السلسلة لعملية مسار عشوائي .

٦- عند خضوع متغير خطا أنموذج الانحدار الذاتي لتوزيعي المنتظم المستمر والمنتظم المتقطع فان  
حصانة معيار بارزن بالنسبة لـ  $(\phi)$  الموجبة افضل من  $(\phi)$  السالبة ولجميع حجم العينات على أن هذه  
الحصانة تتضاؤل بزيادة حجم العينة .

٧- عند خضوع متغير الخطا لتوزيع كوشي ، فان معيار بارزن قد عكس حصانة عالية في حجم العينات  
الكبيرة عدا في حالة المسار العشوائي عند  $\phi$  الموجبة فان الأداء يتضاءل بازدياد حجم العينة .

٨- حصانة تقدير معيار بارزن عند خضوع متغير الخطا لتوزيع  $t$  عند حجم العينات الكبيرة ولمختلف  
أنواع السلاسل وتتزايد بزيادة القيمة المطلقة لمعلمة أنموذج ماركوف النظرية .

٩- عند خضوع متغير الخطا للتوزيع اللوغارتمي الطبيعي فان معيار بارزن قد عكس حصانة عالية عند  
حجم العينة الصغير وتكبر بزيادة قيمة  $(\phi)$  وخصوصا  $(\phi)$  الموجبة في حالة السلاسل الزمنية غير  
المستقرة .