

المستخلص

ابتسام عبد ناصر. تقليص حيز تواجد أفضل معلمة موائمة عند استخدام التقنية في التقدير. (أطروحة دكتوراه). - بغداد : الجامعة المستنصرية : كلية الادارة والاقتصاد : قسم الاحصاء ، ٢٠٠٧ .

من المعلوم للمتبع المهتم بالسلاسل الزمنية، اهمية اسلوب التنقية الموائمة كطريقة للتنبؤ المتوسط والقصير المدى، على ان تلك الطريقة تعتمد وبشكل كبير جدا على قيمة معلمة التمهيد الخاصة بهذا الاسلوب.

لقد اهتم العديد من الباحثين بمعلمة التمهيد (معلمة الموائمة) (k) وحاولوا حصر اماكن وجودها في فترات معينة، كل منهم طبقا لوجهة نظر علمية معينة، فتوصلوا لما توصلوا اليه، على انه كلما تقلصت الفترة التي تحتوي هذه المعلمة كلما كان ذلك افضل لمستخدم هذه الطريقة الذي يروم الوصول لتقديرات المعلمات الافضل باسرع ما يمكن، ان هذا الموضوع سيكون هو محور اهتمامنا في هذا البحث، اذ سنقوم بمحاولة لايجاد فترات اكثر ضيقا مما سبق ووجده باحثون قبلنا، حيث تحتوي تلك الفترات على معلمة التمهيد تلك، على ان محاولة الوصول لهدفنا قد تمت باستخدام التجريب، فتم الحصول على فترات اصغر لتواجد معلمة الموائمة التي نحصل على وفقها نتائج التقدير الموجودة باستخدام التنقية الموائمة على اساس معياري عدد الدورات اللازمة ومعدل الوقت المستغرق وذلك لنماذج $ARMA(p,q)$ مختلفة وانواع سلاسل واحجام عينات مختلفة.