

من المحررين الثانيين

تحليل السلاسل الزمنية

تخصص مالية

و اختيار دول

القوانين الأولى

خطأ: موسمية في التوزيع الحادي تكون غير مستقلة عن الزمن محلي متزايدة أو متناقصة

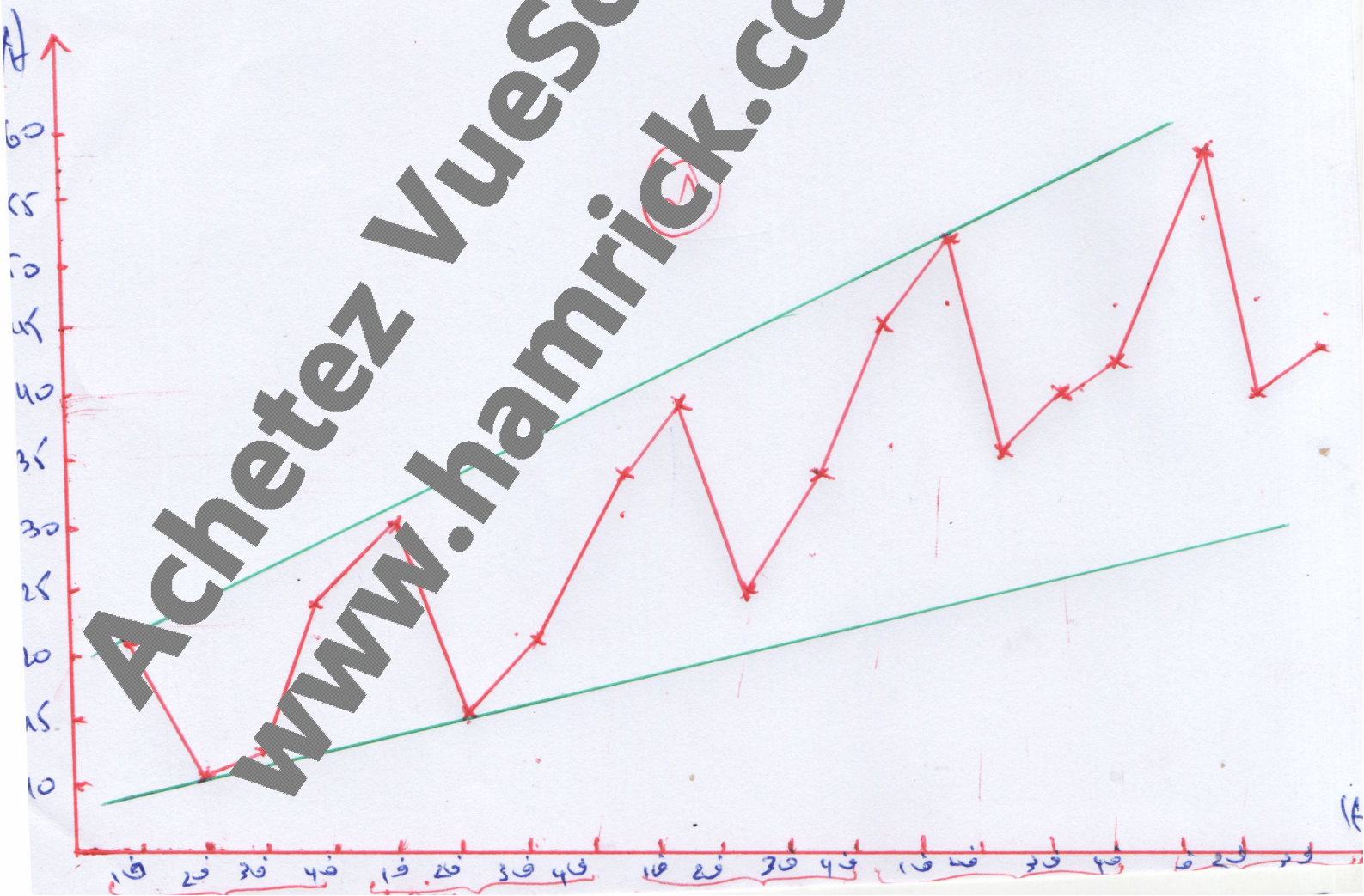
خطأ: كل سلسلة ضجة بيضاء هي سلسلة مستقرة لأنها تحققت الشروط الثلاثة للاستقرارية، لكن ليست بالضرورة كل سلسلة مستقرة هي سلسلة ضجة بيضاء لأنها يمكن أن يكون لها وسط ثابت ولكن ليس بالضرورة

خطأ: تشتت البيانات و تزايد مع الزمن دليل عدم ثبات التباين وبالتالي عدم سكون السلسلة الزمنية

خطأ: السلاسل الزمنية التحديدية TS غير مستقرة بسبب عدم ثبات الوسط الحسابي

خطأ: تتراوح قيمته والاهتمام الذي يبي - 1 و 1 وهي دالة متناظرة حول القيمة صفر

التمرين الثاني



لذلك في هذا المثال وجود مركبة الاتجاه العام مستزاية (ميل موجب)
أيضا وجود مركبة الفصلية حيث تلاحظ وجود قسم في الفصل
الأول من كل سنة و انخفا ضا في الفصل الثاني من كل سنة
بالاضافة الى وجود مركبة العتد ائية . أما العلاقة التي
ترتبط بين سوياء السلسلة الزمنية فهنا علاقة حد ائية
* التحقق من وجود مركبة الاتجاه العام باستخدام الطريقة الانحدارية

t	y _t	t.y _t	t ²	y _t ²
1	121	121	1	14641
2	121	242	4	14641
3	112	336	9	12544
4	123	492	16	15129
5	130	650	25	16900
6	115	690	36	13225
7	122	854	49	14884
8	132	1056	64	17424
9	138	1242	81	19044
10	123	1230	100	15129
11	134	1474	121	17956
12	145	1740	144	21025
13	152	1976	169	23104
14	135	1890	196	18225
15	138	2070	225	19044
16	150	2400	256	22500
17	157	2669	289	24649
18	146	2628	324	19680
19	159	2736	361	25281
20	155	3100	400	24025
210	2677	29468	2870	362105

$$\bar{y} = \frac{\sum y_t}{T} = \frac{2677}{20}$$

$$\text{or } = 133,85$$

$$\bar{t} = \frac{\sum t}{T} = \frac{210}{20}$$

$$\text{or } = 10,5$$

$$b = \frac{\sum y_t t - T \bar{t} \bar{y}}{\sum t^2 - T \bar{t}^2}$$

$$= \frac{29468 - (20)(133,85)(10,5)}{2870 - (20)(10,5)^2}$$

$$= \frac{1359,5}{665}$$

$$= 2,044$$

$$\hat{b} = 2,044$$

أ

$$\hat{\Sigma}_m^2 = \frac{\sum \hat{M}_x^2}{T-2}, \quad \hat{\Sigma}_{M_x}^2 = \sum (y_{xt}^2 - T \bar{y}^2) - b^2 [\sum t^2 - T \bar{t}^2]$$

$$= 3788,55 - (4,177\ 936)(605)$$

$$= 1010,225.$$

$\leq \hat{u}_t^2$

$$\hat{\sigma}_m^2 = \frac{\hat{S}_{MX}^2}{T-2} = \frac{1010,2225}{18} = 56,123$$

$$\delta m^2 = 56,123 \text{ eV}^2$$

$$SE(\hat{\beta}) = \sqrt{\frac{s_n^2}{\sum E^2 - TE^2}} = \sqrt{\frac{56,43}{205}} = \sqrt{0,0843} = 0,29$$

$$SE(\hat{\beta}) = 0,29$$

$$t_c(b) = \frac{b^1}{\Delta E(b)} = \frac{1.4}{0.25} = 7.048.$$

$$t_c(3) = 7,048$$

OK

$t_{\text{calc}} = 2.105$ $t_{\text{table}} = 2.105$
 الفرضية H_1 مقبولة
 مع مستوى دلالة 1%
 اتمام كل الخطوات الفرضية H_1 مقبولة

$$r_{12} = r_{12} = -0,235$$

التأكد من أن 2

$$r_{12} = \frac{\sum (y_t - \bar{y})(y_{t-12} - \bar{y})}{\sum (y_t - \bar{y})^2}$$

$$= \frac{-899,87}{3788,55} = -0,2348 \approx -0,235$$

$$r_{12} = -0,235$$

12

التحليل البياني



التحليل البياني لقسم الذاكرة، نلاحظ وجود علاقة ذاتية، فكلما زاد عدد التكرار، كلما زادت العلاقة.

05

Achetez VueScan maintenant!
www.hamrick.com