

سنة ثالث
سنة أولى ماستري اقتصادي
ومالي

سلسلة التاربي رقم ٥٠

مقاييس
تحليل السلاسل الزمنية

تمرين رقم ٥٥

لدينا الجدول الموالي الذي يوضح قيمة مبيعات سلعة معينة - لشبكة ما
حيث أن البيانات ربع سنوية - أربع سنوات متتالية -

	Q ₁	Q ₂	Q ₃	Q ₄
1	24	20	54	21
2	20	29	74	42
3	22	22	78	39
	15	28	70	46

المطلوب:

- 1 - هل السلسلة متضمنة مركبة الاتجاه، العلم؟
- 2 - اختبر إمكانية وجود المركبة الموسمية ضمن السلسلة.
- 3 - مع تبسيط السلسلة من المركبة الموسمية. في حالة إذا كان النموذج جوهري يتم تحديد (مؤثرين) وهذا بعد أن تحدد المعاملات، لفصلها في كل حالة.

تمرين رقم ٥٥

تعتبر المعادلة التقديرية للإتجاه العام لسلسلة زمنية فصلية
بين سنوات ١٩٨٥ و ١٩٨٥ كما يلي:

$$Y = 6 + 2t + 0.5t^2$$

المعاملات الفصلية 3 ، 2 ، 1 ، 1 ، 2

إذا علمت أن الزمن t بدأ عند القيمة 3 ، 1 ، 2 ، 1 ، 3

- 1 - توضيح شكل السلسلة الزمنية (مجموع / موزون)
- 2 - حساب القيمة التقديرية وفق معادلة الإتجاه العام المعطاة
- 3 - إعداد تكوين السلسلة الزمنية زياً حسب ما سبق