

جامعة محمد بن صديق جيجل

السنة الجامعية: 2023-2024

شعبة العلوم الاقتصادية والتجارية وعلوم التسيير

قسم علوم المحاسبة والمالية

ماستر 1 مالية المؤسسة

امتحان الدورة العادية في مقياس تحليل السلاسل الزمنية

تمرين 01:

1. أذكر أساليب الكشف عن نوع نموذج السلسلة الزمنية.
2. أذكر أهم الاختبار لاختبار مركبة الاتجاه العام بدون شرح.
3. أذكر الفرق بين مركبة الاتجاه العام والمركبة الموسمية والمركبة الدورية.

تمرين 02:

المعطيات الثلاثية التالية خاصة بمتوسط إنفاق الأسر الجزائرية أحد المواد الاستهلاكية خلال 5 سنوات متتالية:

سنة	فصل	S1	S2	S3	S4
1		31.5	31	37	43
2		40	34	37.5	44.5
3		43.5	40.5	49.5	50.5
4		46	43.5	52.5	57
5		54.5	48.5	57	60

الوحدة: بالمليون دينار.

المطلوب:

1. مثل السلسلة الزمنية $\hat{Y}$ بيانيا، ماذا تلاحظ؟
2. اختبر وجود مركبات السلسلة الزمنية $\hat{Y}$ باستخدام اختبار تحليل التباين.
(مع العلم أن $F_{tab} = F_{(4,12)} = 3.26$, $F_{tab} = F_{(3,12)} = 3.49$).
3. اختبر نوع نموذج السلسلة الزمنية $\hat{Y}$ باستخدام اختبار buys-ballots.
4. حدد الاتجاه العام باستعمال طريقة المتوسط المتحرك في حالة ما كان $k=4$.
5. مثل السلسلة MMC (ضمن التمثيل البياني للسلسلة $\hat{Y}$) ماذا تلاحظ؟.