كلية العلوم الاقتصادية والتجارية وعلوم التسيير السنة الجامعية:2023-2024

قسم العلوم الاقتصادية المقياس: تحليل السلاسل الزمنية (ماستر 1)

السلسلة رقم 3 (خاصة بمدخل لتحليل السلاسل الزمنية (المركبة الموسمية))

التمرين الاول:

بالاعتماد على النتائج المتوصل اليها في التمرين الاول لسلسلة السابقة قم باستبعاد اثر الفصول الموسمية.

التمرين الثاني:

تمثل البيانات التالية معدل دوران الأسهم للقطاع المالي في بورصة الجزائر خلال الفترة الممتدة من الفصل الأول لسنة 2010 إلى غاية الفصل الرابع من سنة 2017. .

السنوات	الفصول	معدل دوران الأسهم Y	السنوات	الفصول	معدل دوران الأسهم Y
2010	1	1.075	2014	1	6.168
	2	1.236		2	2.624
	3	0.429		3	5.381
	4	0.85		4	8.666
2011	1	0.483	2015	1	5.37
	2	0.734		2	6.948
	3	1.788		3	6.213
	4	2.083		4	4.581
2012	1	2.027	2016	1	3.545
	2	0.828		2	2.504
	3	2.544		3	1.604
	4	1.131		4	1.107
2013	1	1.337	2017	1	2.662
	2	3.496		2	2.283
	3	4.202		3	2.833
	4	5.396		4	1.647

المطلوب:

1.مثل بيانيا السلسلة الزمنية الخاصة بمعدل دوران الأسهم ماذا تلاحظ وحدد شكل السلسلة؟.

2.قم باستبعاد أثر التغيرات الفصلية؟

التمرين الثالث:

تبين السلسلة الزمنية التالية قيمة مبيعات مادة معينة خلال خمس سنوات:

	2018	2019	2020	2021	2022
جانفي	330	346	327	406	510
فيفري	364	649	442	388	570
مارس	310	364	447	465	573
افريل	312	345	401	405	491
ماي	350	320	351	445	602
جوان	357	323	449	591	555
جويلية	332	333	350	409	553
اوت	200	324	228	272	367
سبتمبر	388	373	381	423	588
اكتوبر	355	313	423	539	696
نوفمبر	351	400	479	515	627
ديسمبر	331	419	434	483	475

المطلوب:

1- مثل بيانيا السلسلة .

2- حدد مركبة الاتجاه العام

3- قم باستبعاد أثر التغيرات الشهرية.

بالتوفيق