

مقارنة بين الطريقة التقليدية Classical Method

و طريقة تحليل الطيف Spectral Analysis لإيجاد ثابت التمهيدي

النكفي a_t عند وجود قيم شاذة Outlier Values

م . م زينب يوسف داود
قسم الإحصاء
الجامعة المستنصرية

م . طاهر ريسان دخيل
قسم الإحصاء
جامعة القادسية

الخلاصة

في هذا البحث تم دراسة مقارنة لطريقتين تعنى بإيجاد القيمة المثلى لثابت التمهيدي التكيفي a_t والذي يستخدم في طريقة التمهيد الاسي التكيفية Adaptive Single Exponential smoothing حيث تمت المقارنة بين طريقة تستخدم مجال الزمن Time Domain وطريقة أخرى تستخدم مجال الترددات Frequency Domain وذلك عند وجود قيم شاذة Outlier Value لنموذج الانحدار الذاتي من الرتبة الأولى AR(1) أو نموذج ماركوف Markov Model عندما تكون السلسلة مستقرة أو غير مستقرة وعند أحجام عينات مختلفة.

Abstract

In this paper , two method which deal with finding the optimal value for adaptive smoothing constant a_t , are compared .This constant is used in adaptive Single Exponential Smoothing (ASES). The comparing is between a method uses time domain and another uses frequency domain when the data contain outlier value for autoregressive model of order one AR(1) , or Markov Model, when the time series are stationary and non stationary with deferent samples .