



المجلة العراقية للعلوم الإحصائية

<http://stats.uomosul.edu.iq>



تشخيص نماذج خطأ المخرجات الحركية ونماذج دالة التحويل-دراسة مقارنة-

سارة موفق عبد القادر¹ و هيام عبدالمجيد حياوي²

قسم الإحصاء والمعلوماتية ، كلية علوم الحاسوب والرياضيات ، جامعة الموصل ، الموصل ، العراق

الخلاصة

في هذا البحث تم تشخيص نماذج دالة التحويل بالاعتماد على بيانات موسمية تمثلت بالسطوع الشمسي كمداخلات ودرجات الحرارة كمخرجات حيث تم الحصول على نموذج موسمي مضاعف استخدم في تشخيص نماذج دالة التحويل فضلا عن تشخيص نماذج خطأ المخرجات المتمثلة بنموذج (OE) ونموذج (BJ) ومقارنة النتائج وتم التوصل الى ان النظم الديناميكية تعطي تشخيص افضل من نماذج دالة التحويل وذلك بالاعتماد على بعض المعايير الاحصائية.

معلومات النشر

تاريخ المقالة:
تم استلامه في 13 ايلول 2020
تم القبول في 11 كانون الاول 2020
متاح على الانترنت في 1 حزيران 2021
الكلمات الدالة:
سلاسل زمنية، دالة التحويل، النظم الديناميكية.

المراسلة:

هيام عبد المجيد حياوي
heyamhayawi@gmail.com

DOI: [10.33899/IQJOSS.2021.168372](https://doi.org/10.33899/IQJOSS.2021.168372) , ©Authors, 2021, College of Computer Science and Mathematic, University of Mosul
This is an open access article under the CC BY 4.0 license (<http://creativecommons.org/licenses/by/4.0/>).

1. المقدمة : Introduction

يعتبر موضوع تحليل السلاسل الزمنية Time Series Analysis من المواضيع الإحصائية المهمة والأساسية لكونها تستحوذ على اهتمام الكثير من متخذي القرارات في مختلف الاختصاصات. ان نموذج السلسلة الزمنية يعتمد بالدرجة الأولى على عنصر الزمن كعامل مستقل لتحديد وتفسير الظاهرة المدروسة واستعمال قيم المتغير التابع لفترات سابقة أي سلوك هذا المتغير في الماضي، وان نموذج السلسلة الزمنية الذي يحوي على متغير واحد يدعى بنموذج سلسلة زمنية ذي متغير واحد، تستخدم فيه البيانات الحالية والسابقة عن متغير واحد فقط، أما نموذج السلسلة الزمنية الذي يستخدم متغيرات أخرى لوصف سلوك السلسلة الزمنية فيدعى بنموذج السلسلة الزمنية المتعدد المتغيرات [11].

2. هدف البحث : Objective Research

يهدف البحث الى تشخيص نموذج دالة التحويل لعناصر المناخ من خلال ادخال منفرد واخراج منفرد. وتشخيص نماذج النظم الديناميكية بمعلمات مختلفة لنماذج خطأ المخرجات والمتمثلة بنموذج (OE) ونموذج (BJ) ومن ثم مقارنة النتائج من خلال بعض المعايير الإحصائية.

3. دالة التحويل : Transfer Function

ان تطوير النماذج الرياضية يعتبر أول خطوة في التصميم وبعد الخطوة الحاسمة لتصميم أي نظام لتطوير نموذج رياضي للنظام المراد السيطرة عليه، اذ ان الاهتمام بالجانب الإحصائي يهتم بالدرجة الاساسية على نماذج دالة التحويل التي تتضمن مدخلا واحدا ومخرجا واحدا عندئذ تسمى بنماذج دالة التحويل أحادية المتغير (univariate) وقد تتضمن نماذج دالة التحويل مخرجا واحدا وعددا من المدخلات وايضا قد تتكون نماذج دالة التحويل من عدد من المخرجات وعدد من المدخلات عندئذ تسمى بنماذج دالة التحويل متعددة المتغيرات [5]، يمكن كتابة صيغة دالة التحويل كالآتي [9]:

$$\left. \begin{aligned} Y_t &= C + v_0 X_t + v_1 X_{t-1} + v_2 X_{t-2} + \dots + v_k X_{t-k} + N_t \\ Y_t &= C + (v_0 + v_1 B + v_2 B^2 + \dots + v_k B^k) X_t + N_t \\ Y_t &= C + v(B) X_t + N_t \end{aligned} \right\} \quad (1)$$

إذ أن:

C : تمثل الحد الثابت. X_t : تمثل سلسلة المدخلات ، Y_t : تمثل سلسلة المخرجات، N_t : تمثل حد الازعاج.
 إذ أن $V(B)$ تشير الى دالة التحويل الخاصة بنماذج بوكس-جنكنز اي ان $v_0, v_1, v_2, \dots$ تمثل أوزان الاستجابة النبضية.

4. دالة الاستجابة النبضية Impulse Response Function

تعتبر دالة الاستجابة النبضية مؤشر للعلاقة بين المدخلات والمخرجات، وان اوزان نبضات الاستجابة $(v_0, v_1, v_2, v_3, \dots)$ تمثل الأثر الذي يحدث في سلسلة المخرجات نتيجة لتغير سلسلة المدخلات بوحدة واحدة، إذ يمكن كتابة دالة الاستجابة النبضية لتوزيع الإزاحات الخطية في شكل عامل الإزاحة الخلفي من خلال تعريف $v(B)$ فأن:

$$\left. \begin{aligned} v(B) &= v_0 + v_1 B + v_2 B^2 + \dots \\ &= \sum_{k=0}^{\infty} v_k B^k \end{aligned} \right\} \quad (2)$$

ويطلق على مجموع أوزان الاستجابة النبضية أسم عائد حالة الاستقرار (Steady State Gain)، إذا تحقق الشرط الآتي:

$$\sum_{k=0}^{\infty} v_k = g \quad (3)$$

إذ أن:

g : تمثل التغير الكلي (التغير المتراكم على مر الزمن) في سلسلة المخرجات الناتج من تغير سلسلة المدخلات بوحدة واحد [4] [12].

5. زمن التأخير Delay Tim

يمثل التأخير الزمني العادي الذي يحدث في المخرجات Y_t نتيجة للتغير الذي حدث في المدخلات X_t ، عادة يشار الى زمن التأخير بالرمز b ، إذ إن b عدد صحيح موجب وفي بعض الأحيان يسمى بالزمن الميت (Dead Time) وبإمكاننا إيجاد قيمة b عند رسم الارتباط المتقاطع بين سلسلة المدخلات X_t وسلسلة المخرجات Y_t حيث ان اول قيمة معنوية تقع خارج فترة الثقة تمثل زمن التأخير b ، ويعد تقدير زمن التأخير مطلباً أساسياً يجب تقديره قبل البدء بتحديد النموذج المناسب الذي يمثل النظام أو العملية، حيث يكون زمن التأخير ذا تأثير مباشر في عملية تحديد النموذج الذي يصف النظام بصورة دقيقة ويوضح آلية عمل النظام [3] [12].

6. أسلوب بوكس-جنكنز في تحليل نماذج دالة التحويل Box-Jenkins Methodology in Transfer Models Analysis

هناك ثلاث مراحل لبناء نموذج دالة التحويل، من خلال الخوارزمية التي وضعها Box-Jenkins في بناء السلسلة الزمنية، وباعتماد على معلومات سلسلة المدخلات والمخرجات Y_t, X_t على التوالي، إذ يمكن تلخيص هذه المراحل بما يأتي:

1. تشخيص نموذج دالة التحويل Identification of Transfer Function Model

الخطوة الأولى في بناء نموذج Box Jenkins هي فحص سلسلة المدخلات والمخرجات من حيث استقرارية السلسلة في الوسط والتباين، بعد التأكد من استقرارية السلسلة تبدأ مرحلة تشخيص النموذج والمتمثلة بالخطوات الآتية [9]:

2. تقدير أوزان دالة التحويل Estimation of Transfer Function Weights

يتم تقدير أوزان دالة التحويل عن طريق :

أ. دالة الارتباط المتقاطع Cross Correlation Function

ب. دالة التحويل الخطية Linear Transfer Function Method (LIF)

3. تحديد رتب نموذج دالة التحويل Specifying Order for Transfer Function Mode

بعد تقدير أوزان دالة التحويل يتم حساب رتب (r, s, b) لنموذج دالة التحويل أي حساب النسبة $\frac{w(B)}{\delta(B)}$ كما يلي:

$$\left. \begin{aligned} v(B) &= \frac{w(B)}{\delta(B)} \\ &= \frac{(w_0 + w_1 B + \dots + w_{s-1} B^{s-1})}{1 - \delta_1 B - \dots - \delta_r B^r} \end{aligned} \right\} \quad (4)$$

حيث (b) تمثل زمن التأخير في الاتجاه الموجب لدالة الارتباط الذاتي وهو الزمن الذي تتعده عنده معنوية الارتباطات بدالة الارتباط التقاطعية، (s) تمثل رتبة بسط دالة التحويل، (r) تمثل رتبة مقام دالة التحويل ويتم تحديدهما من خلال الارتباطات التقاطعية المعنوية بدالة الارتباط التقاطعية (Cross Correlation Function) للسلاسل المفككة.

4. تحديد نموذج ARMA لحد الازعاج N_t . :Determination of the ARMA Model for the Disturbance Term.

بعد تقدير أوزان دالة التحويل الخطوة التالية هي تحديد نموذج ARMA المناسب لحد الازعاج N_t ، ويجب حساب القيم التقديرية لسلسلة الإزعاج N_t ، من خلال النموذج الآتي [6] [12]:

$$\left. \begin{aligned} Y_t &= v(B)X_t + N_t \\ N_t &= Y_t - v(B)X_t \end{aligned} \right\} \quad (5)$$

وان النموذج الملائم يمكن تحديده من خلال فحص دالة الارتباط الذاتي ACF ودالة الارتباط الذاتي الجزئي PACF لسلسلة الإزعاج N_t للحصول على:

$$\phi(B)N_t = \theta(B)a_t \quad (6)$$

وفي حالة إذا كانت سلسلة الازعاج تتبع نموذج SARMA الموسمي المضاعف، يمكن الحصول على سلسلة البواقي a_t التي تمثل حد الازعاج ويعبر عنها كالآتي:

$$\phi(B)\Phi(B)N_t = \theta(B)\Theta(B)a_t \quad (7)$$

5. تقدير معاملات نموذج دالة التحويل Parameters Estimation of Transfer Function Model

بعد ان تم التعرف على شكل نموذج دالة التحويل وتحديد نموذج الازعاج، يتم في هذه الخطوة تقدير جميع المعلمات الموجودة في النموذج الآتي [1] [2]:

$$Y_t = \frac{w(B)}{\delta(B)} X_{t-b} + \frac{\theta(B)}{\phi(B)} a_t \quad (8)$$

6. التحقق من دقة تشخيص النموذج Diagnostic Checking of the Model

بعد أن تم تحديد شكل نموذج دالة التحويل وتقدير جميع معالمته، لابد من اختبار النموذج ويتم عن طريق، اختبار دالة الارتباط الذاتي ودالة الارتباط الذاتي الجزئي لسلسلة البواقي a_t يجب أن تكون عملية حد الازعاج، فأن جميع الارتباطات الذاتية لها يجب أن تكون غير معنوية، بمعنى ان جميع الارتباطات الذاتية والذاتية الجزئية تقع داخل حدود الثقة، كذلك يجب اختبار دالة الارتباط المتقاطع بين سلسلة البواقي وسلسلة المدخلات التي اجري لها إعادة التبييض α_t ، فالتحقق شرط استقلالية السلسلتين يكون من خلال عدم معنوية الارتباطات المتقاطعة بين السلسلتين كافة، وإذا لم يتحقق ذلك فيجب إعادة صياغة النموذج وذلك بتشخيص نموذج آخر [4] [9].

7. النظم الديناميكية Dynamic Systems

يعرف النظام بأنه تفاعل مجموعة من المتغيرات المختلفة التي تنتج اشارات واضحة وهذه الاشارات قد تكون ذات فائدة وتوصف بالمرجات (output). فضلا عن ذلك يتأثر النظام بمؤثرات خارجية تعالج من قبل المستخدم وتوصف بالمدخلات (input). ومنها اشارات خارجية غير مسيطر عليها وتوصف بالاضطرابات او الازعاجات (disturbance). ويتم تصنيف الاضطرابات الى صنفين حيث بعضها يقاس بصورة مباشرة وبعضها الاخر يلاحظ فقط من خلال تأثيرها على المخرجات [8].

8. طرق تقدير زمن التأخير في النظم الديناميكية

يوجد عدد من الطرق لتقدير زمن التأخير في النظم الديناميكية منها:

1. دالة الارتباط المضاعف (الارتباط المستعرض) Cross Correlation Function

2. دالة الاستجابة النبضية Impulse Response Function

3. استخدام نماذج الانحدار الذاتي بمدخلات اضافية Autoregressive with Exogenous inputs Models (ARX)

9. نماذج النظم الديناميكية Dynamic System Models

يتركب النموذج الديناميكي العام General Dynamic Model الذي تشترك منه كل النماذج الديناميكية Dynamic Model والذي غالبا لا يطبق عمليا لأنه يمثل الهيكلية الموحدة للأنظمة الديناميكية حيث يتم حساب المخرجات y_t للنظام الديناميكي عند الزمن t من خلال ترشيح المدخلات X_t بمشرح خطي يرمز له $G(B)$ والذي يسمى بالجزء المحدد ويسمى أيضا بدالة تحويل المدخلات Input Transfer Function، فضلا عن ترشيح حد الازعاج الذي يرمز له N_t بمشرح خطي آخر يرمز له بـ $H(B)$ ويسمى بدالة تحويل الازعاج Noise Transfer Function ويسمى بالجزء الديناميكي، عليه يمكن تمثيل النموذج الخطي العام بالجزئين المحدد والديناميكي بالشكل الآتي:

$$Y_t = G(B)X_t + H(B)N_t \quad (9)$$

ويمكن تمثيل هذا النموذج من خلال متعددات الحدود وهي تراكيب ديناميكية Dynamic Combination كالآتي:

$$Y_t = \frac{B(B)}{F(B)A(B)} X_t + \frac{C(B)}{D(B)A(B)} N_t \quad (10)$$

إذ أن:

$$\left. \begin{aligned} A(B) &= 1 + a_1 B^{-1} + a_2 B^{-2} + \dots + a_{na} B^{-na} \\ B(B) &= b_1 B^{-1} + b_2 B^{-2} + \dots + b_{nb} B^{-nb} \\ C(B) &= 1 + c_1 B^{-1} + c_2 B^{-2} + \dots + c_{nc} B^{-nc} \\ F(B) &= 1 + f_1 B^{-1} + f_2 B^{-2} + \dots + f_{nf} B^{-nf} \\ D(B) &= 1 + d_1 B^{-1} + d_2 B^{-2} + \dots + d_{nd} B^{-nd} \end{aligned} \right\} \quad (11)$$

وأن (nf, nd, nc, nb, na) عدد معاملات متعدّدات الحدود $A(B), B(B), C(B), D(B), F(B)$ على التوالي، وأن B^{-1} يمثل عامل الإزاحة الخلفي Backword shift بمعنى $B^{-1}X_t = X_{t-1}$

وتقسم نماذج النظم الديناميكية الى قسمين:

1. نماذج خطأ المعادلة Equation Error Models

تضم نموذج الانحدار الذاتي مع مدخلات اضافية ARX ونموذج الانحدار الذاتي والمتوسطات المتحركة مع مدخلات اضافية ARMAX، ويمكن تمثيل نموذج ARX بالشكل الآتي:

$$Y_t = \frac{B(B)}{A(B)} X_t + \frac{1}{A(B)} N_t \quad (12)$$

أما نموذج ARMAX فيمكن تمثيله بالشكل الآتي:

$$Y_t = \frac{B(B)}{A(B)} X_t + \frac{C(B)}{A(B)} N_t \quad (13)$$

2. نماذج خطأ المخرجات Output Error Models

تشمل كل من نموذج خطأ المخرجات output error ويرمز له بالرمز OE ونموذج بوكس-جكنز Box Jenkins ويرمز له بالرمز BJ، وتتميز هذه النماذج بوجود نموذج الإزجاج الذي لا يحوي على عملية ديناميكية وبذلك فإن من المفترض أن يؤثر حد الإزجاج على مخرجات العملية مباشرة، بمعنى آخر ان نماذج خطأ المخرجات تتميز بأن نموذج حد الإزجاج فيها مستقل عن نموذج العملية المحددة ويمكن تمثيل نموذج خطأ المخرجات OE بالصيغة الآتية [10]:

$$Y_t = \frac{B(B)}{F(B)} X_t + N_t \quad (14)$$

أما نموذج بوكس-جكنز فيمكن تمثيله بالصيغة الآتية:

$$Y_t = \frac{B(B)}{F(B)} X_t + \frac{C(B)}{D(B)} N_t \quad (15)$$

10. المعايير الإحصائية لاختيار أفضل نموذج

في تحليل السلسلة الزمنية قد تكون هناك نماذج عديدة يمكن ان تستخدم في تمثيل مجموعة من البيانات وإن اختيار أفضل نموذج يمثل البيانات يعتمد على خبرة الباحث ويمكن اعتبار المعايير الإحصائية لاختيار أفضل نموذج أداة مفيدة جدا في هذا الاختيار ومن هذه المعايير:

1. معيار معلومات أكاي: Akaike's Information Criteria (AIC)

يستخدم هذا المعيار للمفاضلة بين النماذج واختيار أحدها لتمثيل حد الإزجاج حيث يتم حساب قيمة AIC للنماذج التي اجتازت الفحوص التشخيصية ومن ثم اختيار النموذج ذو أقل قيمة AIC ليكون النموذج الأفضل، الصيغة العامة لهذا المعيار كالآتي [9] [10]:

$$AIC(m) = n \ln \sigma_a^2 + 2m \quad (16)$$

إذ أن: m : عدد المعلمات المقدرة في النموذج، σ_a^2 : تباين الخطأ.

2. معيار خطأ التنبؤ النهائي لأكاي Akaike's Final Prediction Error Criteria (FPE)

يعد من المعايير المهمة في تحديد الرتبة المناسبة للنموذج، وحسب بالصيغة الآتية [7]:

$$FPE = \sigma^2 \frac{n+m}{n-m} \quad (17)$$

إذ أن: $\hat{\sigma}^2$: تباين الخطأ، n : عدد المشاهدات، m : عدد المعلمات المقدرة في النموذج.

3. دالة الخسارة: Loss Function

تعرف في بعض الأحيان بدالة الكلفة cost Function حيث تعد المتطلب الأساس الأفضل في اختيار رتبة النموذج من خلال ملاحظة سلوك هذه الدالة مع زيادة رتبة النموذج وتحسب بالصيغة الآتية:

$$V = \frac{1}{2} \sum_{t=1}^n e_t^2 \quad (18)$$

إذ أن: V : دالة الكلفة، n : عدد المشاهدات.

3. معيار المطابقة Fitting criteria:

وهو مقياس لمعرفة دقة النموذج كنسبة مئوية وتحسب هذه النسبة بالصيغة الآتية [8]:

$$Fit = 100 * \left[1 - \frac{\sqrt{\sum_{t=1}^n (y_t - \hat{y})^2}}{\sqrt{\sum_{t=1}^n (y_t - \bar{y})^2}} \right] \quad (19)$$

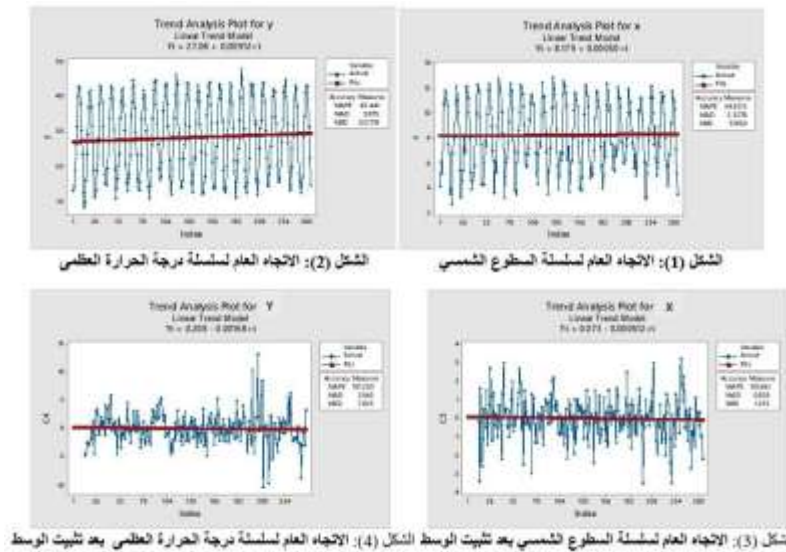
إذ أن: y_t : قيم المخرجات الحقيقية، $\hat{y}$: القيم التقديرية المكونة من النموذج

$\bar{y}$: الوسط الحسابي لمشاهدات سلسلة المخرجات المستخدمة في تكوين النموذج.

11. الجانب التطبيقي

في هذا البحث تم استخدام بيانات مناخية والتي يتم تهيئتها وهي X_t التي تمثل المدخلات (السطوع الشمسي) والمخرجات Y_t (درجة الحرارة العظمى) وتتضمن 264 مشاهدة من المدخلات والمخرجات ويمكن تمثيل سلسلة بيانات المدخلات والمخرجات بالشكلين (1) و (2) الآتيين:

نلاحظ من الشكلين (1) و (2) عدم استقرارية السلسلتين إذا تم اخذ الفرق الموسمي للسلسلتين لجعلها مستقرة موسمياً وكما موضح بالشكلين (3) و (4) الآتيين:



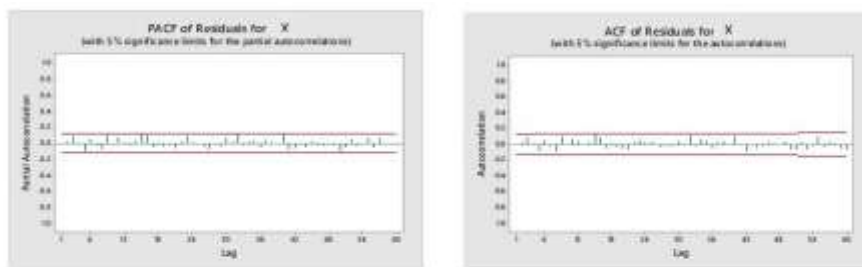
بعد تهيئة سلسلتي المدخلات X_t والمخرجات Y_t يتم تنقيتهما، إذ يتم تنقية سلسلة المدخلات من خلال تحديد النموذج الملائم لها للحصول على سلسلة

البواقي، وذلك بملاحظة سلوك دالتي الارتباط الذاتي والجزئي، وبعد استقرارية السلسلة إذ تبين ان السلسلة المستقرة تتبع نموذج

$SARIMA(1,0,0)(0,0,1)_{12}$ الذي يمتلك اقل MSE وتساوي (0.699) وان القيمة التقديرية للمعلمتين هما: $\phi = 0.1462, \theta = 0.9082$ ولغرض فحص

مدى ملائمة النموذج فقد تم فحص البواقي (Residuals) من خلال رسم دالة الارتباط الذاتي لبواقي المدخلات ودالة الارتباط الذاتي الجزئي لبواقي المدخلات

الموضحة في الشكلين (5) و (6) الآتيين:



الشكل (5): دالة الارتباط الذاتي ACF لبقايا سلسلة الملاحظات



الشكل (6): دالة الارتباط الذاتي الجزئي PACF لبقايا سلسلة الملاحظات

وبتطبيق النماذج الديناميكية نماذج خطأ المخرجات BJ, OE تم توفيق العديد من النماذج بمعلمات متعددة ومختلفة لكل نموذج من النماذج الديناميكية واختيار افضل نموذج حسب المعايير الإحصائية AIC, FPE, LOSS Function لنماذج خطأ المخرجات المتمثلة بنموذج BJ ونماذج دالة التحويل إذ نلاحظ من الجدول (1) إن التشخيص باستخدام نموذج BJ يعطي نتائج افضل من التشخيص باستخدام نموذج دالة التحويل، إذ إن قيمة (AIC) لنموذج BJ اقل من قيمتها في نموذج دالة التحويل، كذلك فإن قيمة خطأ التنبؤ النهائي لأكافي (FPE) في نموذج BJ اقل من قيمتها في نموذج دالة التحويل، كذلك فإن قيمة متوسط مربعات الخطأ (MSE) لنموذج BJ أقل من قيمتها في نموذج دالة التحويل.

جدول (1): قيم المعايير الإحصائية لنموذج BJ ونموذج دالة التحويل

النموذج	التشخيص باستخدام نموذج دالة التحويل			التشخيص باستخدام نموذج BJ		
	AIC	FPE	MSE	AIC	FPE	MSE
X	2.5664	6.719	4.513	1.570	4.812	4.14

12. الاستنتاجات

1. السلاسل الزمنية لبيانات المدخلات والمخرجات كانت سلسلة موسمية ومستقرة بالتباين لعدم وجود أي تنبذات فيها وكذلك تبين من خلال دالتي الارتباط الذاتي والذاتي الجزئي أنها غير مستقرة موسمياً وتم علاج ذلك بأخذ الفرق الموسمي لسلسلتي المدخلات والمخرجات.
2. عند بناء نموذج دالة التحويل تبين أن النموذج الملائم بعد توفيق عدة نماذج لسلسلتي المدخلات والمخرجات عبارة عن نموذج موسمي مضاعف SARIMA (p,d,q)(P,D,Q)₁₂ وتم تشخيص افضل نموذج بالاعتماد على قيمة MSE وفحص البواقي.
3. من ملاحظة النتائج في الجدول (1) تبين أن نموذج (BJ) الذي يصف العلاقة بين متغير الأخراج (y) الذي يمثل درجة الحرارة العظمى ومتغير الإدخال (x) الذي يمثل السطوع الشمسي أعطى قيماً للمعايير الإحصائية أقل مما هي عليه في نموذج دالة التحويل.

Reference

1. Al-Badrani, Dhafer Ramadan Matar and Al-Hayali, Omar Salem Ibrahim, (2013): "Tawfiq a dynamic model of the water filtration process in the city of Mosul," Iraqi Journal of Statistical Sciences, Volume (23).
2. Hayawi, Hayam Abd al-Majid and Al-Tawi, Ahmed Salem Ismail, (2012): "Employing the factorial analysis approach to predict transfer function models," Iraqi Journal of Statistical Sciences, Vol. (21).
3. Hayawi, Hayam Abdel-Majid, (2006): "Diagnosis of stochastic linear motion systems through their relationship with time", PhD thesis (unpublished), College of Computer Science and Mathematics, University of Mosul, Iraq.
4. Fandel, Walter, (1983): "Time Series from the Applied Point of View and Box-Jenkins Models", Arabization of Abdul Mardi Azzam (1992), Mars Publishing House, Riyadh, Saudi Arabia.
5. Jenkins, G.M., (1979), "Practical Experiences with Modelling Forecasting Time Series", Gwilym Jenkins & Partners.
6. Liu, L.M., (2006): "Time Series Analysis and Forecasting", 2nd ed., Scientific Computing Associates Crop., Illinois, USA.
7. Ljung, L., (1999): "System Identification Theory for The User", 2nd ed. Prentice Hall Upper Saddle River N.J. London U.K.
8. Ljung, L., (2004): "System Identification Toolbox for use with MATLAB", 6.0 MathWorks Inc.
9. Makridaskis, S. Wheelwright, S. and Hyndman, R. (1998): "Forecasting: Methods and Application", 3rd ed., John Wiley and Sons, New York, USA.
10. Nelles, O., (2001): "Nonlinear System Identification from Classical Approach to Neural Network and Fuzzy Model", springer Verlag Belin Heidelberg Germany.
11. Wei, W.W.S. (1990), "Time Series Analysis Univariate and Multivariate Methods", Addison-Wesley Publishing Company, Inc., The Advanced Book Program, California, USA.

12. Yaffee, R.A. and McGee, M., (1999): "Introduction to Time Series Analysis and Forecasting with Applications of SAS and SPSS", Academic Press, INC.

Output Error Dynamic Models Identification and Transfer Function - A comparative study –

Sarah Muwaffaq Abdel Qader Heyam Abdel Majeed Hayawi
College of Computer Science and Mathematic, University of Mosul

Abstract: In this research, the transfer function models were diagnosed based on seasonal data represented by solar brightness as inputs and temperatures as outputs, where a double seasonal model was obtained which was used in diagnosing the transfer function models as well as diagnosing the output error models represented by the (OE) model and the (BJ) model and compared the results. Finding that the dynamic systems give a better diagnosis than the transfer function models, depending on some statistical criteria .

Keyword: Time Series, Transfer Function , Dynamic Systems.