الجمهورية الجزائرية الديموقراطية الشعبية
وزارة التعليم العالي و البحث العلمي
جـــــامعة سطيـف 1 فرحات عباس
كلية العلوم الاقتصادية والتجارية وعلوم التسيير
قسـم: العلوم الاقتصادية

مـــــذكـــــــرة

مقدمة ضمن متطلبات الحصول على شهادة الماسترفي العلوم الاقتصادية

تخصص: اقتصاد كمي وإحصاء

الموضـــوع:

التنبؤ بمعدلات التضخم في الجزائر باستخدام نماذج ARCH-GARCH خلال الفترة جانفي 2002 إلى أوت 2025

إعداد الطالبة:
عكيف نور الهدى

تحت إشراف:
بن عمرة عبد الرزاق

تاريخ المناقشة: 2026/06/27

لجنة المناقشة		
الرئيس	بن عامر نبيل	أستاذ
المشرف	بن عمرة عبد الرزاق	أستاذ محاضر ب
المناقش	بوحصان لامية	أستاذ محاضر أ

السنة الجامعية: 2025 - 2026

تهدف هذه الدراسة إلى التنبؤ بمعدلات التضخم في الجزائر باستخدام نماذج ARCH-GARCH خلال الفترة جانفي 2002 إلى أوت 2025.

تم الاعتماد في الجانب النظري على المنهج الوصفي، وذلك من خلال استعراض أهم المفاهيم النظرية المتعلقة بالتنبؤ وبظاهرة التضخم، كما تم توظيف المنهج التحليلي من خلال تحليل تطور معدل التضخم السنوي في الجزائر خلال الفترة الممتدة من سنة 2002 إلى سنة 2024.

أما في الجانب التطبيقي فقد تم استخدام المنهج القياسي، حيث تم تطبيق أساليب إحصائية واختبارات قياسية باستخدام نماذج ARCH-GARCH على معدل التضخم الشهري الذي يعتبر المتغير الرئيسي في هذه الدراسة.

أظهرت النتائج أن نموذج ARCH-M (1) بتوزيع Student 's t هو النموذج الأنسب للتنبؤ بمعدلات التضخم في الجزائر، لكونه النموذج الوحيد الذي حقق شرط المعنوية الإحصائية لجميع المعلمات مع إشارة تتوافق مع منطق النظرية الاقتصادية مقارنة بباقي النماذج المقدرة، كما أثبتت الإختبارات قدرة هذا النموذج على التقاط الصدمات مما يعكس فعاليته في توقع القيم المستقبلية لمعدلات التضخم.

الكلمات المفتاحية: التنبؤ، معدل التضخم، الاقتصاد الجزائري، نماذج ARCH-GARCH.

This study aims to forecast inflation rates in Algeria using ARCH-GARCH models during the period from January 2002 to August 2025.

The theoretical aspect relied on the descriptive approach by reviewing the most important theoretical concepts related to forecasting and the phenomenon of inflation. The analytical approach was also employed by analyzing the evolution of the annual inflation rate in Algeria during the period from 2002 to 2024.

In the applied aspect, the econometric approach was used, where statistical methods and econometric tests were applied using ARCH-GARCH models to the monthly inflation rate, which is considered the main variable in this study.

The results showed that the ARCH-M (1) model with Student's t distribution is the most suitable model for forecasting inflation rates in Algeria, as it is the only model that met the statistical significance condition for all parameters with signs consistent with the logic of economic theory compared to the other estimated models. The tests also proved the model's ability to capture shocks reflecting its effectiveness in predicting future values of inflation rates.

Keywords: forecasting, inflation rate, Algerian economy, ARCH-GARCH models.

Cette étude vise à prévoir les taux d'inflation en Algérie en utilisant les modèles ARCH-GARCH durant la période de janvier 2002 à août 2025.

Sur le plan théorique, la méthode descriptive a été adoptée, à travers la présentation des principaux concepts théoriques liés à la prévision et au phénomène de l'inflation. De plus, la méthode analytique a été employée en analysant l'évolution du taux d'inflation annuel en Algérie durant la période allant de 2002 à 2024.

Quant à l'aspect appliqué, la méthode économétrique a été utilisée, où des méthodes statistiques et des tests économétriques ont été appliqués en utilisant les modèles ARCH-GARCH sur le taux d'inflation mensuel, qui constitue la variable principale de cette étude.

Les résultats ont montré que le modèle ARCH-M(1) avec une distribution Student's t est le modèle le plus approprié pour prévoir les taux d'inflation en Algérie, car il s'agit du seul modèle qui a satisfait la condition de significativité statistique pour tous les paramètres, avec un signe conforme à la logique de la théorie économique par rapport aux autres modèles estimés. Les tests ont également prouvé la capacité de ce modèle à capter les chocs, ce qui reflète son efficacité dans la prévision des valeurs futures des taux d'inflation.

Mots-clés : prévision, taux d'inflation, économie algérienne, modèles ARCH-GARCH.