

عنوان الماستر: اقتصاد كمي وإحصاء

السداسي: الأول

اسم الوحدة: وحدة تعليم أساسية وت أس 1.1

اسم المادة: اقتصاد قياسي ديناميكي

الرصيد: 6

المعامل: 3

نمط التعليم: حضوري

أهداف التعليم:

يهدف التعلم في هذه المادة الى اكتساب مهارات في تقدير العلاقات الاقتصادية بتمثيلها في شكل صيغ رياضية مختلفة من شأنها تسهيل تفسير الواقع الاقتصادي واختبار النظريات الاقتصادية واستخدامها في التخطيط والتنبؤ.

المعارف المسبقة المطلوبة :

الرياضيات (تحليل وجبر)، الاحصاء الوصفي، نظرية الاحتمالات، التحليل الاحصائي واختبار الفروض، التحليل الاقتصادي الجزئي، التحليل الاقتصادي الكلي، السياسات الاقتصادية.

محتوى المادة:

المحور الأول:مدخل إلى النمذجة القياسية الديناميكية

المحور الثاني:نماذج الانحدار الذاتي لفترات الإبطاء الموزعة (ARDL)

المحور الثالث:نماذج شعاع (متجه) الانحدار الذاتي (VAR)

المحور الرابع:التكامل المشترك

المحور الخامس:نماذج قياسية ديناميكية متقدمة

المحور السادس:أمثلة تطبيقية على البرمجيات الإحصائية

طريقة التقييم:

المحاضرة: امتحان كتابي

المراقبة المستمرة: امتحان + اعمال شخصية

المراجع:

- غزال عبد العزيز عامر (2015)، الاقتصاد القياسي وتحليل السلاسل الزمنية (النظرية، الطرق، التطبيقات)، مطابع الشرطة، مصر.

- محمد عبد القادر عطية (2004)، الحديث في الاقتصاد القياسي بين النظرية والتطبيق، الدار الجامعية للطباعة والنشر.

- David F. Hendry (1995), « Dynamic Econometrics », Oxford University Press, USA.
- Jack Johnston, John Dinardo (1996), «Econometric methods », 4th Edition, McGraw-Hill, US.
- James D. Hamilton (1994), «Time Series Analysis », Princeton University Press, New Jeracy, US.
- Iain Pardoe : « Applied Regression Modeling », Third Edition, Wiley, 2021.
- Maddala G. S (1992), « Introduction to econometrics », second edition, MacMillan Publishing Company, New York, US.

- **M. Hashem Pesaran and al (2001), « Bounds Testing Approaches to the Analysis of Level Relationships », Journal of Applied Econometrics, May - Jun. 2001, Vol. 16, No. 3.**
- **William H. Greene (2012), «Econometric analysis », 7th Edition, Pearson, New York, US.**