

عنوان الماستر: إقتصاد نقدي ومالي

السداسي: الثاني

إسم المادة : إقتصاد قياسي مالي

الأرصدة: 05

المعامل: 02

أهداف التعليم: تعليم الطالب طرق نمذجة المشاكل المالية والتنبؤ.

المعارف المسبقة المطلوبة:

- الإحصاء الوصفي، الاحتمالات، الإحصاء الرياضي، مبادئ القياس الاقتصادي.

محتوى المادة:

المحور الأول: صياغة نماذج التقلبات المالية والاقتصادية نماذج EGARCH, GARCH, ARCH

المحور الثاني: نماذج المتغير التابع المحدد؛

المحور الثالث: نموذج متجه الانحدار الذاتي VAR؛

المحور الرابع: نموذج تسعير الأصول الرأسمالية CAPM؛

طريقة التقييم:

- تقييم مستمر وإمتحان نهائي 60% للمحاضرة و 40% للأعمال موجهة.

المراجع:

- Financial econometrics (models and methods), Oliver Linton.
- Traite d'économétrie financière, modélisation financière (Francoiseric Racicot, Raymond Theret)
- Économétrie de la finance, Guillaume Simon
- Économétrie de la finance (analyses historiques), Chritiane Gourieroux, Olivier Scaillet, Ariane szfarz.