

عنوان الماستر: اقتصاد رقمي

السداسي: الثاني

اسم الوحدة: أساسية

اسم المادة: إقتصاد قياسي متقدم

الرصيد: 5

المعامل: 2

نمط التعليم: حضوري

أهداف التعليم:

تهدف هذه المادة إلى تمكين الطالب من استخدام الأساليب الرياضية والإحصائية لدراسة العلاقات الاقتصادية، ويتم ذلك بدراسة كيفية إيجاد تقدير لهذه العلاقات وتفسير سلوك المتغيرات الاقتصادية. وعلى وجه التحديد، ويسمح ذلك اكتساب مهارات تسمح له بـ:

- النمذجة القياسية للمتغيرات الكيفية
- النمذجة القياسية وفق نماذج غير خطية
- النمذجة القياسية لبيانات البائل

المعارف المسبقة المطلوبة :

التحكم في الرياضيات خاصة الجبر الخطي والمصفوفات، الاقتصاد الجزئي والكلي؛ الإحصاء بكل فروعه، الاقتصاد القياسي، السلاسل الزمنية.

محتوى المادة:

- **المحور الأول :** النماذج غير الخطية (Non linear models)
- **المحور الثاني:** نماذج بيانات البائل (Panel Data)
- **المحور الثالث:** نماذج متقدمة لبيانات البائل
- **المحور الرابع:** أمثلة تطبيقية على البرمجيات الإحصائية

طريقة التقييم: تقييم مستمر + امتحان نهائي ويقاس معدل المادة بالوزن الترجيحي للدروس (60%) والأعمال الموجهة (40%)

المراجع:

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

✓ Badi H. Baltagi (2005), « Econometric Analysis of Panel Data », Third Ed, John Wiley and Sons Ltd, England.

- ✓ Christophe Hurlin (2006), Valérie Mignon, « une synthèse des tests de cointégration sur données de panel », Université d'Orléans, France.
- ✓ David F. Hendry (1995), « Dynamic Econometrics », Oxford University Press, US.
- ✓ Jack Johnston, John Dinardo (1996), «Econometric methods », 4th Edition, McGraw-Hill, US.
- ✓ William H. Greene (2012), «Econometric analysis », 7th Edition, Pearson, New York, US.
- ✓ Wooldridge, Jeffrey M. (2010). Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data. MIT Press.
- ✓ Hamilton, James D. (1994). Time Series Analysis. Princeton University Press.
- ✓ Dougherty, Christopher (2016). Introduction to Econometrics. Oxford University Press.
- ✓ Cameron, A. Colin and Trivedi, Pravin K. (2005). Microeconometrics: Methods and Applications. Cambridge University Press.
- ✓ Davidson, Russell and MacKinnon, James G. (2004). Econometric Theory and Methods. Oxford University Press.
- ✓ Amemiya, Takeshi (1985). Advanced Econometric Theory. Harvard University Press.
- ✓ Campbell, John Y., Lo, Andrew W., and MacKinlay, A. Craig (1997). The Econometrics of Financial Markets. Princeton University Press.
- ✓ Arellano, Manuel (2003). Panel Data Econometrics. Oxford University Press.
- ✓ Baum, Christopher F. (2006). Limited Dependent and Qualitative Variables in Econometrics. Cambridge University Press.
- ✓ Barnett, William A. (1995). Nonlinear Econometric Models: Theory and Applications. Cambridge University Press.