

عنوان الماستر: اقتصاد كمي وإحصاء

السداسي الثالث

اسم الوحدة: وحدة تعليم أساسية وت أس 1.2

اسم المادة: اقتصاد قياسي متقدم

الرصيد: 6

المعامل: 3

نمط التعليم: حضوري

أهداف التعليم:

التعرف على مختلف المفاهيم المرتبطة بالاقتصاد القياسي المتقدم، وأهم طرق التقدير والتحليل للنماذج القياسية المتقدمة (للمتغيرات الكيفية والنماذج غير الخطية وليبيانات البائل).

المعارف المسبقة المطلوبة:

الرياضيات خاصة الجبر الخطي والمصفوفات، الاقتصاد الجزئي والكلّي؛ الإحصاء بكل فروعه، اقتصاد قياسي 1، اقتصاد قياسي 2، اقتصاد قياسي ديناميكي، سلاسل زمنية 1، سلاسل زمنية 2.

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: النمذجة القياسية للمتغيرات الكيفية (Qualitative variables).

المحور الخامس: 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.

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

- 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.