

عنوان الماستر: إقتصاد نقدي ومالي

السداسي: الأول

إسم المادة : تحليل السلاسل الزمنية

الأرصدة: 02

المعامل: 02

أهداف التعليم: تمكين الطالب من معالجة مختلف السلاسل الزمنية وتحليلها والقيام بالتنبؤ والمحاكاة.

المعارف المسبقة المطلوبة: إحصاء 1، إحصاء 2، الإحصاء الرياضي.

محتوى المادة:

المحور الأول: مفاهيم أساسية في السلاسل الزمنية والعمليات العشوائية؛

المحور الثاني: عملية جذر الوحدة العشوائية؛

المحور الثالث: عمليات عشوائية ساكنة ذات اتجاه عام وأخرى ذات فروق؛

المحور الرابع: العمليات العشوائية المدمجة؛

المحور الخامس: ظاهرة الانحدار الزائف؛

المحور السادس: اختبار السكون؛

المحور السابع: اختبار جذر الوحدة؛

المحور الثامن: AR, MA, ARMA لنمذجة بيانات السلاسل الزمنية؛

المحور التاسع: طريقة BOX.Jenkins.

طريقة التقييم:

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

المراجع:

- Économétrie de séries temporelles macroéconomiques et financières, Sandrine Lardic Valérie Mignon, Paris 2002.
- Analyse des séries temporelles : application à l'économie et à la gestion, Régis Bourbonnais, Michel Tarraza, Dunod, France 2016.
- Séries temporelles et modèles dynamiques (2° édition), Christian Gouriéroux, 1995 France.