

عنوان الماستر: الإدارة المالية

السادسي: الأول

اسم الوحدة: وحدة تعليم استكشافية

اسم المادة: تحليل السلاسل الزمنية

الرصيد: 02

المعامل: 02

نمط التعليم: حضوري

أهداف التعليم:

تزويد الطالب بفهم أساسي للطبيعة والعمليات المستخدمة لتحليل بيانات السلاسل الزمنية والعمل على تقدير توجهات السلسلة والتنبؤ بقيم الظواهر الاقتصادية المدروسة.

المعارف المسبقة المطلوبة:

- تمكن الطالب من الجبر الخطي والإحصاء الوصفي

محتوى المادة:

- مفاهيم حول تحليل السلاسل الزمنية
- نماذج الانحدار الذاتي-المتوسط المتحرك ARMA
- تمهيد السلاسل الزمنية
- النماذج القياسية الدينامكية
- ويتمثل العمل الشخصي للطالب في مراجعة المحاضرات وإعداد البحوث والإطلاع على مختلف المراجع.

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

المراجع:

- تومي صالح، (1999)، مدخل لنظرية القياس الاقتصادي، ديوان المطبوعات الجامعية، الجزائر.

- Hamilton, J. D. (2020). Time series analysis. Princeton university press.
- Madsen, H. (2007). Time series analysis. CRC Press.
- Palma, W. (2016). Time series analysis. John Wiley & Sons.