

السداسي:الأول

اسم الوحدة: المنهجية

اسم المادة: تحليل السلاسل الزمنية

الرصيد: 05

المعامل: 02

أهداف التعليم: (ذكر ما يفترض على الطالب اكتسابه من مؤهلات بعد نجاحه في هذه المادة، في ثلاثة أسطر على الأكثر)

- تعلم العديد من أدوات تحليل السلاسل الزمنية ومجالات استخدامها وضوابطها
- تعلم منهجية التحليل المنطقي للبحوث والمذكرات
- المعارف المسبقة المطلوبة : (وصف تفصيلي للمعرف المطلوبة والتي تمكن الطالب من مواصلة هذا التعليم، سطرين على الأكثر).
- تمكن الطالب من الجبر الخطي والاحصاء

محتوى المادة: (إجبارية تحديد المحتوى المفصل لكل مادة مع الإشارة إلى العمل الشخصي للطالب)

المحور الأول: مفاهيم تحليل السلاسل الزمنية ومركباتها

المحور الثاني: اختبارات استقرارية السلاسل الزمنية

المحور الثالث: النماذج الخطية للسلاسل الزمنية

المحور الرابع: منهجية بوكس جينكينز

المحور الخامس: طرق التكامل المشترك

المحور السادس: نماذج أشعة الانحدار الذاتي

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

المراجع: (كتب، ومطبوعات ، مواقع انترنت، إلخ)

- 1- شيخي محمد (2011). طرق الاقتصاد القياسي- محاضرات وتطبيقات. الأردن. دار الحامد.
- 2- عطية عبد القادر محمد عبد القادر (2004). الحديث في الاقتصاد القياسي بين النظرية والتطبيق. الإسكندرية. الدار الجامعية.

3- كرسي بروكس (2020)، الاقتصاد القياسي التمهيدي للمالية، دار جامعة الملك سعود للنشر، المملكة العربية السعودية.

4-Alain Pirotte et Georges Bresson(1995), Econométrie des séries temporelles – Théorie et Applications, 1 éme édition, Presse Universitaire de France, Paris

5-Bourbonnais Régis(2018).Econométrie. 10eédition. Paris. France. DUNOD

6-Régis Bourbonnais'(2011), Econométrie – Manuel et exercices corrigés, 9 éme édition, Dunod,Paris

7-Badi H, Baltagi (2011), Econometrics. 5e edition. Springer-Verlag Berlin Heidelberg

8-William Greene(2005), Traduction de la 5 éme édition par Théophile Azomahou et NicolasCoudec,« Econométrie », édition française dirigée par Didier Schlachter, IEP Paris,Université Paris I