

عنوان الماستر: مالية البنوك والتأمينات

السداسي: الثاني

اسم الوحدة: وحدة تعليم استكشافية

الرمز: وت أس 2.1

اسم المادة: اقتصاد قياسي مالي

الرصيد: 02

المعامل: 02

نمط التعليم: حضوري

#### أهداف التعليم:

معرفة الطالب لأهم خصائص نماذج السلاسل المالية من أجل استخدامها كأداة ومنهجية في اتخاذ القرار وتحليل الأسواق المالية، والاستعانة بها في انجاز البحوث العلمية التطبيقية خاصة منها مذكرات التخرج.

مع اكتساب مهارات تسمح له بـ:

- القدرة على نمذجة السلاسل المالية ومعرفة أهم خصائصها.
- معرفة أهم النماذج غير الخطية.
- اكساب الطالب القدرة على نمذجة وتحليل ظواهر الأسواق المالية التي تتميز بديناميكية حركية غير خطية وسرعة التقلبات، وذلك بالاعتماد على نماذج ARCH/GARCH .

#### المعارف المسبقة المطلوبة :

الرياضيات+ السلاسل الزمنية + الاقتصاد القياسي.

#### محتوى المادة:

- العمليات غير الخطية
- نماذج ARCH/GARCH

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

1. Hurlin C. Econométrie pour la Finance Modèles ARCH–GARCH, Applications à la VaR .Université d’Orléans, France(2007) .
2. Bourbonnais. R, Terraza. M, 2010 « Analyse des séries temporelles » Applications à l’économie et à la gestion, 3e édition, Paris

3. GOURIEROUX C., SCAILLET, O. et SZAFARZ A. (1997) :  
Econométrie de la finance : Analyses historiques, Economica
4. CAMPBELL J.Y., LO A.W. and MACKINLAY A.C. (1996) :  
The econometrics of financial markets, Princeton university press.