

عنوان الماستر: مالية المؤسسة

السداسي: الثاني

اسم الوحدة: وحدة تعليم منهجية

الرمز: وت م 2.1

اسم المادة: اقتصاد قياسي مالي

الرصيد: 05

المعامل: 02

نمط التعليم: حضوري

أهداف التعليم:

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

- العمليات غير الخطية.

- نماذج ARCH/GARCH.

طريقة التقييم:

تقييم مستمر + امتحان نهائي ويقاس معدل المادة بالوزن الترجيحي للدروس (60%) والأعمال الموجهة (40%)

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

1. Bourbonnais. R, Terraza. M, (2010): Analyse des séries temporelles, Applications à l'économie et à la gestion, 3e édition, Paris.
2. GOURIEROUX C., SCAILLET, O. et SZAFARZ A. (1997) : Econométrie de la finance : Analyses historiques, Economica.
3. CAMPBELL J.Y., LO A.W. and MACKINLAY A.C. (1996): The econometrics of financial markets, Princeton university press.