

مالية وبنوك إسلامية

السداسي: الثاني

اسم الوحدة: الوحدة التعليمية المنهجية

اسم المادة: اقتصاد قياسي مالي

الرصيد: 5

المعامل: 2

نمط التعليم: حضوري

أهداف التعليم: يهدف المقياس الى تمكين الطالب من تطبيق الطرق الإحصائية في التقييم العملي للعلاقات الاقتصادية والمالية والذي يستخدم على نطاق واسع في الاقتصاد الدولي لتقدير أسباب وأثار التجارة الدولية وأسعار الصرف وحركات رأس المال الدولية ومختلف الظواهر الاقتصادية والمالية

المعارف المسبقة المطلوبة:

أن يكون الطالب ملم ب: إحصاء 2 – إحصاء 3 - إحصاء 4.

محتوى المادة:

- العمليات العشوائية المستقرة وعمليات ARMA
- 1 - تذكير بأهم المفاهيم الأساسية في الإحصاء والاحتمالات
- 2 - السلاسل الزمنية
- 3 - العمليات المستقرة
- نظرية وولد (Wold)
- عمليات نماذج (ARMA)
- اختبارات الاستقرار والعمليات العشوائية غير مستقرة
- العمليات غير مستقرة
- 2 - اختبار جدر الوحدة واختبار ديكي فولر
- 3 - اختبار ديكي فولر المحسن
- 4 - عمليات (نماذج)
- عدم تجانس التباين المشروط
- 1 - محدودية نماذج ARMA
- 2 - نماذج ARCH

- 3- نماذج GARCH
- 4 - امتدادات نماذج ARCH:
- 4-1 نماذج GARCH الغير متناظرة : نموذج TGARCH وEGARCH
- 4-2 نموذج GARCH-M

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

المراجع:

1. حسين بخيت، اقتصاد قياسي، دار اليازوري العلمية للنشر والتوزيع، 2017.
2. Asteriou D. and S. G. Hall, 2007, Applied Econometrics, A Modern Approach Using Eviews and Microfit, Revised Edition, Palgrave Macmillan, chapter 11.
3. Greene W. H., 2008, Econometric Analysis, 6th Edition, Pearson Education, chapter 20.