

## عنوان الماستر: اقتصاد كمي وإحصاء

### السداسي الثاني

اسم الوحدة: وحدة تعليم أساسية وت أس 2.1

اسم المادة: اقتصاد قياسي مالي

الرصيد: 6

المعامل: 3

نمط التعليم: حضوري

#### أهداف التعليم:

يهدف هذا المقرر الى تنمية المعارف لدى الطالب في نمذجة الظواهر المتعلقة بالقطاع المالي عن طريق تحليل السلاسل الزمنية للبيانات المالية.

#### المعارف المسبقة المطلوبة:

اقتصاد قياسي 1 و 2 ، تحليل السلاسل الزمنية.

#### محتوى المادة:

المحور الأول: مدخل مفاهيمي لنماذج الانحدار الخطية وغير الخطية.  
المحور الثاني: نمذجة بيانات السلاسل الزمنية في القطاع المالي.  
المحور الثالث: نماذج الانحدار الذاتي المشروط بتجانس التباين ARCH، GARCH، EGARCH ، ARCH-M ، (التعريف بالنموذج، طرق التقدير والتنبؤ، الاختبارات)  
المحور الرابع: طريقة اللحظات المعممة.  
المحور الخامس: طرق حديثة لنمذجة بيانات الأسواق المالية.

طريقة التقييم: مراقبة مستمرة، امتحان.... إلخ ( يُترك الترخيص للسلطة التقديرية لفريق التكوين )

المحاضرة: امتحان كتابي

المراقبة المستمرة: امتحان كتابي + تقييم مستمر

#### المراجع:

- كريس بروكس، الاقتصاد القياسي التمهيدي للمالية، ترجمة عبد الله بن محمد المالكي ووليد المنصف العمراني، دار الجامعة الملك سعود للنشر، 2020.
- François Éric Racicot, Raymond Théoret: «Traité d'économétrie financièreModélisation financière », Presses de l'Université du Québec, 2001.
- Andrew J. Filardo, Stephen F. Gordon : « Dynamic Modeling and Econometrics in Economics and Finance », Philip Rothman (eds.) - Nonlinear Time Series Analysis of Economic and Financial Data-Sprin
- Jemes D. Hamilton, Time series Analysis, 1st Edition