

عنوان الماستر: مالية المؤسسة

السداسي: الأول

اسم الوحدة: وحدة تعليم استكشافية

الرمز: وت م 1.1

اسم المادة: تحليل السلاسل الزمنية

الرصيد: 02

المعامل: 02

نمط التعليم: حضوري

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

- ربط المفاهيم والقواعد النظرية باستخداماتها التطبيقية.

- استيعاب المفاهيم المتعلقة بالسلسلة الزمنية وطرق تقدير مركباتها والكشف عنها، والإستقرارية، بنوعها التامة والضعيفة، ودالي الارتباط الذاتي والذاتي الجزئي وطرق تقديرهما وأهم التحويلات الرياضية لجعل السلسلة مستقرة.

- معرفة أهم نماذج التمهيد الأسّي للتنبؤ بالسلاسل الزمنية بالتركيز على التمهيد الأسّي البسيط والمضاعف، وكذلك عرض طريقة التنبؤ لهولت ووينترز.

- تنمية القدرة على استخدام بعض البرامج الرياضية المستخدمة في هذا المجال.

المعارف المسبقة المطلوبة: (وصف تفصيلي للمعارف المطلوبة والتي تمكن الطالب من مواصلة هذا التعليم، سطرين على الأكثر).

مقياس السلاسل الزمنية إنما يعتمد على النماذج الاحتمالية والإحصاء الاستدلالي. لذلك لابد من استيعاب المفاهيم الرياضية بعموميتها.

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

عموميات حول السلاسل الزمنية وتقدير مركباتها.

الإستقرارية والارتباط الذاتي والجزئي.

نماذج التمهيد الأسّي للتنبؤ بالسلاسل الزمنية.

طريقة التقييم:

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

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

1. سمير مصطفى شعراوي، مقدمة في التحليل الحديث للسلاسل الزمنية، كلية العلوم، جامعة الملك عبد العزيز، المملكة العربية السعودية، الطبعة الأولى، 2005.
2. مولود حشمان، نماذج وتقنيات التنبؤ على المدى القصير، ديوان المطبوعات الجامعية، ط4، الجزائر، 1998.
3. **Bourbonnais. R, Terraza.** « Analyse des séries temporelles » Applications à l'économie et à la gestion, 3e édition , Paris
4. **Daudin, JJ, Duby. C, Robin.S et P. Trécourt. (1996).** « Analyse des Séries Chronologiques ». INAPG, Mathématiques.
5. **Delignieres. D, (Janvier 2001)** « L'analyse des processus stochastiques ». EA 2991 "Sport performance, santé", Université de Montpellier 1.
6. **Maddala.G.S, (1988)** "Introduction to econometrics", Mac Millan publishing company, New York, USA, 1988.
7. **Hamilton. J-D (2016).** "Time Séries Analysis". Princeton University Press, 2016