

السنة الجامعية: 2023 - 2024

المستوى: أولى ماستر
التخصص: اقتصاد كمي
المدة: ساعة ونصف.



جامعة العربي بن مهيدي - أم البواقي -
كلية العلوم الاقتصادية والعلوم التجارية وعلوم التسيير
قسم: علوم اقتصادية

الإجابة النموذجية لامتحان الدورة العادية في مقياس اقتصاد قياسي مالي

العلامة	السؤال/ الأول الجزء 1	
1	خطأ: النماذج غير الخطية تناسب السلاسل الزمنية المالية لما تشهده من تقلبات	1
1	خطأ : عنقودية التقلب نقصد بها كل التغيرات الموجبة تليها تغيرات موجبة أخرى ، و التغيرات السالبة تليها تغيرات سالبة	2
1	خطأ : يعتمد كل منهما على مبدأ ، الشبكات العصبية تعتمد على المربعات الصغرى	3
1	صحيح	4
04	المجموع	

النقاط	السؤال الأول الجزء 2	
02	<p>خصائص البيانات المالية :</p> <p>التفرطح الضعيف عنقودية التقلب اثر الرفع المالي</p> <p>الاختلاف الجوهرى بين المخاطر المنتظمة و غير المنتظمة :</p> <p>أن المخاطر المنتظمة لا يمكن التحكم بها و التنبؤ بها ، لكن المخاطر غير المنتظمة يمكن التقليل منها و التحكم فيها عن طريق التنويع</p>	
08	المجموع	

النقاط	السؤال الثاني
--------	---------------

1.5	1. التأكد من أثر arch الفرضية الصفرية : لا يوجد اثر (لثبات تباين) الفرضية البديلة : يوجد اثر (تباين غير ثابت)	
1.5	من خلال الجدول نلاحظ ان قيمة معنوية الاختبار اقل من 0.05 و بالتالي نرفض الفرضية الصفرية و نقبل الفرضية البديلة أي يوجد اثر لarch	
01	2. شكل رقم 1: TGARCH	
01	شكل رقم 2: ARCH	
01	شكل رقم 3: GARCH	
02.03	3. تفسير النتائج كل نموذج تكتب معادلته (معادلة المتوسط) و معادلة التباين و اختبار صلاحية النموذج عن طريق اشارة المعلمات	
	4. الفرق بين نموذج arch tgarch، أن نموذج tgarch يهتم و يدرس الصدمات السالبة و الموجبة	
12		المجموع