



אוניברסיטת בן-גוריון בנגב  
הפקולטה למדעי הרוח והחברה

המחלקה לכלכלה      תשע"ז-מסטר ב' 2017

שם הקורס בעברית: מבוא לאקונומטריקה

שם הקורס באנגלית: Introduction to Econometrics

מס' קורס: 142-1-1081

שם המרצה: ד"ר סלימאן אבו בדר

מטרות הקורס

בסוף הקורס סטודנטים מצופים -

- להשתמש בטכניקות אקונומטריות לאמידת ובדיקת קשרים בין משתנים כלכליים
- להשתמש בתוכנה STATA ליישום הכלים התיאורטיים שנלמדו בהרצאות
- להבין את החשיבות של הנחות מודל הרגרסיה הלינארית הקלאסית, להעריך תוצאות אי קיומן של הנחות אלו ולפתור את הבעיות הנוצרות כתוצאה מאי קיום הנחות אלו
- לקרוא ולהבין ביתר קלות מאמרים אמפיריים ולפתח חשיבה ביקורתית כלפי אסטרטגיות אמפיריות הנמצאות בשימוש

דרישות קדם

קורסי מבוא לכלכלה + סטטיסטיקה לכלכלנים ב

מבנה הקורס

הקורס מורכב מהרצאה ותרגול שבועיים. השיעורים יוקדשו להצגת נושאי הלימוד. במסגרת התרגול תתבצע הרחבה של חלק מהנושאים שכוסו בהרצאה ויערך דיון בשאלות מהתרגילים.

אמצעי תקשורת

כל החומר הרלוונטי לקורס נמצא באתר הקורס ב – Moodle. שעות הקבלה של המרצה והמתרגלים נועדו לאפשר לסטודנטים לקבל עזרה פרטנית לגבי הנושאים המכוסים בקורס. פניות לגבי נושאים לוגיסטיים יש להפנות XXX.

## דרישות הקורס

א. נוכחות חובה של לפחות 80% מהשיעורים. מי שלא מגיע לפחות ל 80% מהשיעורים לא יהיה רשאי לגשת לבחינה הסופית.

### ב. תרגילים

לאורך הסמסטר יינתנו כ- 11 תרגילים. תרגילים יוגשו בתחילת התרגול. **אין חובת הגשת תרגילים**, עם זאת אנו מציעים לכם לנסות לפתור את התרגילים ולהשקיע בהם מספיק זמן גם אם אתם מחליטים לא למסור את הפתרון למתרגל/ת. פתרון תרגילים הוא חלק עיקרי בהבנת החומר הנלמד ובהכנת הסטודנט לקראת הבוחן/ מבחן ועל כן אנו שומרים לעצמנו את הזכות להכניס שאלות מהתרגילים לבוחן ו/או למבחן. פתרון חלק מהשאלות דורש שימוש בתוכנה STATA. בסיום הקורס אנו מצפים מכם לשלוט היטב בתפעול התוכנה, להבין את משמעות הפלט שהתוכנה נותנת ולהכיר ולזכור את הפקודות שיש לתת לתוכנה לביצוע החישובים והאמידות השונות. משקל של בין 10 ל 15 נקודות בבוחן ו/או במבחן יינתן לשליטה בתוכנה. חוברת הסבר בסיסית על התוכנה נמצאת באתר הקורס. בנוסף, הסברים והדרכה יינתנו במהלך התרגולים לאורך הקורס. הבחינות בקורס זה מתבססות גם על התרגילים ועל השימוש בתוכנה המלווה את הקורס.

### ג. בחן אמצע

במהלך הסמסטר יתקיים בוחן אמצע בתאריך **28.04.17** בשעה 9:00

### ד. בחינה סופית

בסוף הקורס תתקיים בחינה שתכלול את כל החומר שנלמד בקורס. ציון סופי משוקלל של 56 וציון מינימלי של 56 **בבחינה הסופית**, נדרשים על מנת לעבור את הקורס.

מועד א' יתקיים בתאריך **20.7.2017** ומועד ב' יתקיים בתאריך **13.8.2017**.

## שקלול הציון הסופי של הקורס

25	בוחן אמצע
75	בחינה סופית
100	סה"כ

## ספר בסיסי

שלושה ספרים מלווים את הקורס. מרבית חומר ההרצאות מבוסס על הספר הראשון ברשימה. הספרים האחרים מציגים לפרקים גישה אלטרנטיבית לטיפול בחומר הנלמד.

- Principles of Econometrics - R. Carter Hill, William E. Griffiths and Guay C. Lim, 3<sup>rd</sup> Edition, John Wiley & Sons, Inc.
- Introduction to Econometrics – James Stock and Mark Watson, 3<sup>rd</sup> Edition,
- Basic Econometrics - Domar Gujarati, 4<sup>th</sup> Edition, McGraw-Hill, New York

– הספר המלווה את השימוש ב – STATA הינו –

- Using Stata for Principles of Econometrics – Lee C. Adkins and R. Carter Hill, 3<sup>rd</sup> Edition, John Wiley & Sons, Inc.

כל הספרים נמצאים בספרייה.

**תכנית טנטטיבית לקורס**

מס' הרצה	נושא	Stock & Watson	Gujarati	Hill, Griffiths and Lim
1	הקדמה רגרסיה דו-משתנית – אומד OLS ותכונותיו	4.1-	1,2	1,2
2	הנחות קלאסיות ומשמעותן תכונות סטטיסטיות של אומדני OLS תחת ההנחות הקלאסיות – חוסר הטיה, עקיבות וחישוב שונות משפט Gauss-Markov	4.4, 5.5, -	3,4	1,2
3	ההבדל בין מתאם לסיבתיות בדיקת השערות אמידת רווח בר סמך של המקדמים ושל השונות בדיקת השערות חד-צדדיות ודו-צדדיות של המקדמים תחזית	5.1-5.2, 5.6-5.7	5	3
4	רגרסיה ללא חותך פונקציות לא לינאריות	8	6	7
5	רגרסיה מרובה – אומד OLS ותכונותיו משמעויות מקדמי רגרסיה מרובה מולטי קולינאריות מלאה בדיקת השערות – מבחן T להשערה פשוטה מבחן F להשערות מורכבות	6.2-6.8	7,8	5,6
6	מובהקות המודל השמטת משתנה רלוונטי/הוספת משתנה לא רלוונטי משתני דמה אינטראקציות בין משתנים מבחן של שינוי מבני (CHOW Test)	6.1, 7, 8.3- 8.5	9	6.6, 7
7	מולטיקולינאריות חלקית – תכונות אומדי OLS, אבחון הבעיה ופתרונה שונות משתנה (הטרוסקדסטיות) - תכונות אומדי OLS,	6.7, 5.4	10,11	6.7, 8
8	שונות משתנה (הטרוסקדסטיות) – מבחן לזיהוי, אמידה (FGLS, GLS)	5.4-5.7, 15.4	10,11	6.7, 8
9	מתאם סדרתי – משמעות, תכונות אומדי OLS, מבחן LM לאבחון, אמידה באמצעות FGLS	,14.2-14.3 15.4		9
10	אנדוגניות – משמעות, תכונות OLS, אמידה באמצעות שיטת המומנטים, שימוש במשתנה עזר, מבחנים לזיהוי אנדוגניות ולטיב משתני העזר	12	18	10
11	משוואות סימולטניות	12	18	11
12	- Panel Data Models Fixed Effects Model Random Effects Model	10	16, 18	15
13	שיעור חזרה			