



אוניברסיטת בן-גוריון בנגב  
הפקולטה למדעי הרוח והחברה

המחלקה לכלכלה תשע"ו 2016

שם הקורס בעברית: מימון אמפירי

שם הקורס בעברית: Empirical Finance

מס' קורס (במידה ומדובר בשינוי פרטי קורס): 142-2-0016

שם המרצה: ד"ר כורש גליל

### יעדי ההוראה:

קורס זה מיועד לתמידי מחקר בתחום המימון. הקורס אמור להקנות לסטודנטים את הידע הנדרש בכדי להבין מחקרים אמפיריים במימון וכן את הכלים הבסיסיים הנדרשים לביצוע מחקר אמפירי במימון.

### פרשיות לימודים:

הנושאים שידונו בקורס זה הם:

1. תכונות אמפיריות של נכסים פיננסיים.
2. תחזית תשואות והשערת היעילות האינפורמטיבית של שווקים.
3. מבחנים למהלך מקרי.
4. חקר אירוע.
5. מודל ה-CAMP: תאוריה ומבחנים סטטיסטיים.
6. מודלים רב-גורמיים לתמחור במימון: תאוריה ומבחנים סטטיסטיים.
7. תיקוף אסטרטגיות השקעה של קרנות גידור.
8. מודלים לחזוי פשיטת רגל.

**דרישות והרכב ציון הקורס \***

		<b>משקל בציון הסופי **</b>	
בחירה	X חובה	_____ % -	נוכחות
		_____ % -	בחנים ***
		20 % -	עבודות
		80 % -	מבחנים
		_____ % -	סיורים
		100% -	סה"כ

**רשימה ביבליוגרפית:**

Campbell, John Y., Andrew Wen-Chuan Lo, and Archie Craig MacKinlay. The econometrics of financial markets. Princeton, NJ: princeton University press, 1997.