



אוניברסיטת בן-גוריון בנגב
הפקולטה למדעי הרוח והחברה

תשע"ז 2017 המחלקה לכלכלה

שם הקורס בעברית: מימון אמפירי

שם הקורס באנגלית: Empirical Finance

מס' 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 אמפריות 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

עבודות	- 20 %
מבחנים	- 80 %
סה"כ	- 100%

רשימה ביבליוגרפית:

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