



אוניברסיטת בן-גוריון בנגב
הפקולטה למדעי הרוח והחברה

תשע"ו 2016

המחלקה לכלכלה

שם הקורס בעברית: מבוא לאקונומטריקה

שם הקורס אנגלית: Introduction to Econometrics

מס' קורס: 142.1.1081

שם המרצה: ד"ר קרין ואן דר בק

יעדי ההוראה:

בסוף הקורס סטודנטים מצופים -

- להשתמש בארגז הכלים האקונומטרי לאמידת ובדיקת קשרים בין משתנים כלכליים
- להשתמש בתוכנה STATA ליישום הכלים התיאורטיים שנלמדו בהרצאות
- להבין את החשיבות של הנחות מודל הרגרסיה הליניארית 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

פרשיות לימודים:

מס' הרצאה	נושא
1	הקדמה רגרסיה דו-משתנית – אומד OLS ותכונותיו
2	הנחות קלאסיות ומשמעותן תכונות סטטיסטיות של אומדני OLS תחת ההנחות הקלאסיות – חוסר הטייה, עקיבות וחישוב שונות משפט Gauss-Markov
3	ההבדל בין מתאם לסיבתיות בדיקת השערות אמידת רווח בר סמך של המקדמים ושל השונות בדיקת השערות חד-צדדיות ודו-צדדיות של המקדמים תחזית
4	רגרסיה ללא חותך פונקציות לא ליניאריות
5	רגרסיה מרובה – אומד OLS ותכונותיו משמעויות מקדמי רגרסיה מרובה מולטי קולינאריות מלאה בדיקת השערות – מבחן T להשערה פשוטה מבחן F להשערות מורכבות
6	מובהקות המודל השמטת משתנה רלוונטי/הוספת משתנה לא רלוונטי

משתני דמי אינטרקציות בין משתנים מבחן של שינוי מבני (Chow Test)	
מולטיקולינאריות חלקית – תכונות אומדי OLS, אבחון הבעיה ופתרונה שונות משתנה (הטרוסקדסטיות) - תכונות אומדי OLS,	7
שונות משתנה (הטרוסקדסטיות) – מבחן לזיהוי, אמידה (FGLS, GLS)	8
מתאם סדרתי – משמעות, תכונות אומדי OLS, מבחן LM לאבחון, אמידה באמצעות FGLS	9
אנדוגניות – משמעות, תכונות OLS, אמידה באמצעות שיטת המומנטים, שימוש במשתנה עזר, מבחנים לזיהוי אנדוגניות ולטיב משתני העזר	10
משוואות סימולטניות	11
- Panel Data Models Fixed Effects Model Random Effects Model	12
Randomized and Natural Experiments Differences-in-Differences	13

דרישות והרכב ציון הקורס

משקל בציון הסופי	
נוכחות	- % בחירה
בחנים	- % 25
מבחנים	- % 75
סה"כ	- 100%

רשימה ביבליוגרפית:

אנגלית:

- Principles of Econometrics - R. Carter Hill, William E. Griffiths and Guay C. Lim, 3rd Edition, John Wiley & Sons, Inc.
- Using Stata for Principles of Econometrics – Lee C. Adkins and R. Carter Hill, 3rd Edition, John Wiley & Sons, Inc.