



אוניברסיטת בן-גוריון בנגב
הפקולטה למדעי הרוח והחברה

המחלקה לכלכלה תשע"ז-סמסטר א' 2017

שם הקורס בעברית: מבוא לאקונומטריקה

שם הקורס באנגלית: Introduction to Econometrics

מס' קורס: 142-1-1081

שם המרצה: ד"ר קרין ואן דר בק

מטרות הקורס

- להשתמש בטכניקות אקונומטריות 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.

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.

דרישות הקורס

א. תרגילים

את התרגילים יש להוריד מאתר הקורס ולהגישם דרך אתר הקורס לפני התרגול (עד 10:00). פתרון חלק מהשאלות בתרגיל דורש שימוש בתוכנה STATA. חוברת הסבר בסיסית על התוכנה נמצאת באתר הקורס. בנוסף, הסברים והדרכה יינתנו במהלך התרגולים במהלך הקורס.

תרגיל ירשם כמוגש רק אם היה ניסיון לפתור לפחות 2/3 מהשאלות והתרגיל כלל את פלטי המחשב הרלוונטיים.

הגשת התרגילים בקורס היא חובה ואי הגשה של לפחות 80% מהתרגילים תגרור הורדה של 5 נק' בציון הסופי. שימו לב כי הבחינות בקורס מתבססות גם על התרגילים ועל השימוש בתוכנת ה-stata המלווה את הקורס.

ב. בוחן אמצע

במהלך הסמסטר יתקיים בוחן אמצע שמשקלו 20% מן הציון הסופי. מועד הבוחן 16.12.2016.

ג. 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.**

שקלול הציון הסופי של הקורס

20%	בוחן אמצע
80%	בחינה סופית
100%	סה"כ

ד. לתלמידים החוזרים הקורס
הגשת התרגילים והבוחן הם חובה.

ספר בסיסי

שלושה ספרים מלווים את הקורס. מרבית חומר ההרצאות מבוסס על הספר הראשון ברשימה. הספר השני מציג לפרקים גישה אלטרנטיבית לטיפול בחומר הנלמד. הספר השלישי משמש בעיקר ללימוד הנושאים האחרונים הנלמדים בקורס.

- Principles of Econometrics - R. Carter Hill, William E. Griffiths and Guay C. Lim, 3rd Edition, John Wiley & Sons, Inc.
- Basic Econometrics - Domar Gujarati, 4th Edition, McGraw-Hill, New York
- Mostly Harmless Econometrics – Joshua D. Angrist and Jorn-Steffen Pischke, 1 edition, Princeton University Press

הספר המלווה את השימוש ב – STATA הינו –

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

כל הספרים נמצאים בספרייה. לספר Mostly Harmless Econometrics קיימת מהדורה אלקטרונית שהינה נגישה דרך המחשב.

תוכנית טנטטיבית לקורס

מס' הרצאה	נושא
	תרגול חזרה
1	מודל הרגרסיה הליניארית רגרסיה פשוטה – הנחות קלאסיות ומשמעותן חישוב אומדי OLS רגרסיה ללא חותך
	תרגיל 1 – מודל הרגרסיה הליניארית
2	תכונות אומדי OLS חוסר הטייה, עקיבות וחישוב שונות תכונות אומדי OLS
	תרגיל 2 – אומדי ריבועים פחותים
3	בדיקת השערות

	אמידת רווח בר סמך של המקדמים ושל השונות בדיקת השערות חד-צדדיות ודו-צדדיות של המקדמים טיב ההסבר
	Stata – (בתרגול על מחשבים)
	תרגיל 3 – בדיקת השערות
4	תחזיות ושונות התחזית - לתוחלת / לערך הבודד
	תרגיל 4 – תחזיות + לימוד מודלים לא ליניאריים
5	רגרסיה מרובה – אומדי OLS ותכונותיהם משמעות המקדמים ברגרסיה מרובה מולטי קולינאריות מלאה
	תרגיל 5 – מודלים לא ליניאריים + לימוד שינוי יח' מדידה
6	בדיקת השערות – מבחן T להשערה פשוטה מבחן F להשערות מורכבות מבחן F למובהקות המודל מולטי קולינאריות חלקית טעויות ספסיפיקציה והשמטת משתנה רלוונטי/הוספת משתנה לא רלוונטי
	תרגיל 6 – רגרסיה מרובה
7	משתני דמי אינטראקציות בין משתנים מבחן של שינוי מבני (CHOW Test)
	תרגיל 7 – דמי
8	אנדוגניות – אמידה באמצעות שיטת משתני העזר (IV) מבחנים לזיהוי אנדוגניות ולטיב משתני העזר
	תרגיל 8א – אנדוגניות (כללי)
9	אנדוגניות – משוואות סימולטניות
	תרגיל 8ב – אנדוגניות (סימולטניות)
10	שונות משתנה (הטרוסקדסטיות)
	תרגיל 9 - הטרוסקדסטיות
11	מתאם סדרתי
	תרגיל 10 - מתאם סדרתי
12	- Panel Data Models

Fixed Effects Model Random Effects Model	
- Panel Data Models Fixed Effects Model Random Effects Model	12
תרגיל 11 – נתוני פאנל	