

מבוא לאקונומטריקה

סמסטר ב' תש"ע
מרצה: ד"ר ניר דגן
מתרגל: מר אור ליביס
הרצאה: יום ג בשעות 15-18
תרגול: יום א
שעת קבלה של המרצה: יום ג בשעות 11-12

מטרות הקורס

- לקראת סוף הקורס סטודנטים מצופים
- להשתמש בטכניקות אקונומטריות לאמידת ובדיקת קשרים בין משתנים כלכליים, ולהבין את משמעות הממצאים שלכם.
 - לבדוק השערות אודות המקדמים שנאמדו.
 - להשתמש במחשב ובחבילת התוכנה EVIEWS (או בחבילה אחרת)
 - 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 וחומר שמכיל חלקים אמפיריים

דרישות קדם

תורת המחירים א' (14211031), מאקרו כלכלה א' (14211051), סטטיסטיקה לכלכלנים ב (14210030).

מבנה הקורס

הקורס מורכב משיעור ומתירגול שבועי. השיעורים יוקדשו להצגת נושאי הלימוד. במסגרת התירגול יערך דיון בשאלות מהתרגילים.

דרישות הקורס

א. תרגילים

לאורך הסמסטר יינתנו כ-10 תרגילים. תרגילים יוגשו בתחילת התרגול השבועי. פתרון חלק מהשאלות דורש שימוש במחשבים ובתוכנות מתאימות. הסברים והדרכה יינתנו במהלך התרגולים לאורך הקורס. הבחינות בקורס זה מתבססות גם על התרגילים. סטודנטים חוזרים על הקורס חייבים להגיש את התרגילים. אין הגשת תרגילים באיחור. שיתוף פעולה בעבודה על תרגילים: סטודנטים רשאים לעבוד בקבוצות על התרגילים. עם זאת, כל סטודנט נדרש להגיש את הפתרון שלו עצמו. סטודנטים לא רשאים להעתיק פתרונות מסטודנטים אחרים, או לעבוד בשיתוף פעולה כזה שאותו הפתרון (או פתרון-כמעט-זהה) יוגש ע"י שני סטודנטים.

ב. בוחן

במהלך הסמסטר יתקיים בוחן אחד. ביום 25.11.09 בשעת התרגול

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:

הגשת תרגילים 10 נקודות

בוחרן אמצע 15 נקודות

בחינה סופית 75 נקודות

סה"כ 100

ספר בסיסי

Domar Gujarati, Basic Econometrics, 4th Edition, McGraw-Hill, New York

ספרים נוספים:

שמואלי עמיר, מושגי יסוד באקונומטריקה (שני כרכים), האוניברסיטה הפתוחה.

תוכנית הקורס

בסוגריים קריאות מהספר הבסיסי.

1. הקדמה. אומד OLS ותכונותיו. רגרסיה דו-משתנית (1,2)
2. הנחות קלאסיות ומשמעותן. תכונות סטטיסטיות של אומדני OLS תחת ההנחות הקלאסיות. משפט גאוס-מרקוב (3,4).
3. בדיקת השערות. אמידת רווח בר סמך של המקדמים. בדיקת השערות חד-צדדיות ודו-צדדיות של המקדמים. רווח בר סמך לתחזית. (5)
4. רגרסיה מרובה – אומד OLS ותכונותיו. משמעויות מקדמי רגרסיה מרובה. מולטיקולינאריות מלאה. בדיקת השערות – מבחני F ו-T להשערות פשוטות ומורכבות (7,8,9).
5. פונקציות לא לינאריות רגרסיה ללא חותך. (6)
6. משתני דמה. אינטרקציות של משתנה דמה ומשתנים אחרים מבחן של שינוי מבני של צ'או (9).
7. מולטיקולינאריות חלקית – תכונות אומדי OLS. אבחון הבעיה ופתרונה (10,11).
8. שונות משתנה - תכונות אומדי OLS אבחון הבעיה ופתרונה (10,11)
9. מתאם סדרתי – משמעות, תכונות אומדי OLS. אבחון הבעיה ופתרונה (5,12).
10. משוואות סימולטניות (18).