

האוניברסיטה העברית בירושלים

סילבוס

אקונומטריקה ב' - 71990

תאריך עדכון אחרון 12-09-2023

נקודות זכות באוניברסיטה העברית: 3

תואר: מוסמך

היחידה האקדמית שאחראית על הקורס: כלכלת סביבה וניהול

השנה הראשונה בתואר בה ניתן ללמוד את הקורס: 0

סמסטר: סמסטר ב'

שפת ההוראה: אנגלית

קמפוס: רחובות

מורה אחראי על הקורס (רכז): פרופ' איל קמחי

דוא"ל של המורה האחראי על הקורס: Ayal.kimhi@mail.huji.ac.il

שעות קבלה של רכז הקורס: בתאום מראש

מורי הקורס:

תאור כללי של הקורס:

במהלך הקורס נעבור על נושאים נבחרים באקונומטריקה תוך דגש על הבנת המודלים המתאימים לכל נושא והיכולת ליישם בעבודה אמפירית.

מטרות הקורס:

למידה והתנסות במגוון של שיטות אקונומטריות מתקדמות.

תוצרי למידה

בסיומו של קורס זה, סטודנטים יהיו מסוגלים:
לבצע עבודה אמפירית עצמאית ברמה גבוהה.

דרישות נוכחות (%) :
100

שיטת ההוראה בקורס: שיעור + תרגיל

רשימת נושאים / תכנית הלימודים בקורס:

1. רגרסיה ליניארית
חזרה על המודל הכללי; טעויות בניסוח המודל; גישת המומנטים; משתני עזר (IV);
2. גישת הנראות המקסימלית
אומד הנראות המקסימלית (אנ"מ); תכונות האנ"מ; אנ"מ ברגרסיה ליניארית; מבחן יחס הנראות
3. משתנים תלויים איכותיים
משתנה תלוי בינארי; מודל ההסתברות הליניארית (model probability linear); האלגוריתם של ניוטון-רפסון; מודל המשתנה הסמוי; פונקציית הנראות; שיטות אמידה; מודל הפרוביט (probit); פונקציית הנראות; בחינת טיב ההתאמה; משמעות המקדמים; מודל הלוג'יט (logit); משתנה תלוי פוליכטומי; פרוביט מסודר (probit ordered); מודלים לא מסודרים
4. משתנים תלויים מוגבלים
מודל טוביט (tobit); אומד נראות מקסימלית; אמידה בשני שלבים; משמעות המקדמים; בחינת טיב ההתאמה; מודל המדגם הלא-אקראי (selection sample); רגרסיות מתחלפות (switching); מודל (double hurdle) הכפולה המשוכה מודל; ביקוש פונקציות לאמידת יישום; (regression); תדירות הקניה (infrequency purchase)
5. אמידה לא-פרמטרית; אמידת פונקציות צפיפות; רגרסיה לא-פרמטרית; רגרסית ג'יני; אמידה חצי פרמטרית
6. נתוני פאנל
7. אמידה בעזרת סימולציות
8. משוואות סימולטניות עם משתנים מוגבלים
9. סדרות עיתיות
10. פירוק הפרשים במשתנה תלוי בעזרת רגרסיה

11. פירוק אי שוויון בעזרת רגרסיה

12. הערכת מדיניות

חומר חובה לקריאה:

אין

חומר לקריאה נוספת:

כללי

Wooldridge, Jeffrey M., *Introductory Econometrics, A Modern Approach*, 2003,
2006, 2009 /330.182 WOO

Darnell, Adrian C., *A dictionary of econometrics*, 1994 /330.182.03-DAR

Baltagi, Badi H., *Econometrics*, 1999 /330.182-BAL

Greene, William H., *Econometric analysis*, 1993,1997,2003 /330.182-GRE
Handbook of econometrics

רגרסיה ליניארית ומשוואות סימולטניות

Pindyck, Robert S., *Econometric models and economic forecasts*, 1991
/338.544-PIN

Mukherjee, Chandan, *Econometrics and data analysis for developing countries*,
1998 /330.182-MUK

משתנים איכותיים ומוגבלים

Maddala, G.S., *Limited-dependent and qualitative variables in econometrics*, 1983
/330.182-MAD

Gaurieroux, Christian, *The econometrics of qualitative dependent variables*, 1996
/330.182-GOU

Lee, Myoung-jae, *Methods of moments and semiparametric econometrics for
limited dependent variable models*, 1996 /330.182-LEE

נתוני פאנל

Laszlo, Matyas, and Sevestre, Patrick (eds.), *The econometrics of panel data*, 1996
/330.182-ECO

Baltagi, Badi H., *Econometric analysis of panel data*, 1995 /330.182-BAL

Wooldridge, Jeffrey M., *Econometric analysis of cross section and panel data*, 2002
/330 WOO

Lee, Myoung-jae, *Panel data econometrics: Methods of moments and limited
dependent variables*, 2002 /330 LEE

STATA

001516671

Author Pevalin, David J.

Title *The Stata survival manual [electronic resource]* / Pevalin and Robson.

מרכיבי הציון הסופי :

הגשת עבודה מסכמת / פרויקט גמר / מטלת סיכום / מבחן בית / רפרט 80 %
מטלות הגשה במהלך הסמסטר: תרגילים / עבודות / מבדקים / דוחות / פורום / סימולציה ואחרות
20 %

מידע נוסף / הערות:

אין