



תאריך עדכון: 7/6/2009

## שם ומספר הקורס: שיטות מחקר במימון 70-816

סוג הקורס: שיעור

שנת לימודים: תש"ע סמסטר: א, ב' היקף שעות: 2

אתר הקורס באינטרנט: יעודכן

**א. מטרת הקורס (מטרות על / מטרות ספציפיות):**  
מטרת הקורס היא לחשוף את הסטודנטים לטכניקות ולכלים המקובלים בביצוע מחקר אמפירי במימון. הקורס כולל הרצאות תיאורטיות ותרגול באמצעות החבילה הסטטיסטית SAS.

### ב. תוכן הקורס:

חזרה ומושגי יסוד, רגרסיה לינארית פשוטה ורבת משתנים, אומדני ריבועים פחותים (OLS), אומדי נראות מכסימאלית (MLE), The Generalized Least Square, (GLS), Model Selection Techniques, רגרסיה לא לינארית, משוואות סימולטניות, ניתוח סדרות עיתיות, ניתוח שונות חד כיווני ודו כיווני, מודלים של משתנים קטגוריים, ניתוח נתוני פאנל, The Generalized Method of Moments (GMM)

### מהלך השיעורים:

הרצאות פרונטליות ותרגול על SAS במעבדת המחשבים

### תכנית הוראה מפורטת לכל השיעורים (ייתכנו שינויים):

מס' השיעור	נושא השיעור	קריאה מומלצת (לעדכונים)	הערות
1	חזרה ומושגי יסוד: משתנים מקריים, מומנטים ופונקציות התפלגות, אמידה סטטיסטית ומשפט הגבול המרכזי (CLT), The Method of Moments, מושגי יסוד באלגברה של מטריצות	9-27 61-91 Greene מ (נתון לעדכונים)	
2	רגרסיה לינארית פשוטה ורבת משתנים The Ordinary Least Square (OLS)	210-238	
3	תרגול במעבדה		

	123-133 456-472	Maximum Likelihood Estimation The Generalized Least Square (GLS)	4
	652-692	Model Selection Techniques משוואות סימולטניות 2SLS, SUR, 3SLS רגרסיה לא לינארית	5
		תרגול במעבדה	6
		ניתוח שונות חד כיווני ודו כיווני	7
	811-828 875-879	מודלים של משתנים קטגוריים Logit, Probit, Ordered Probit	8
		תרגול במעבדה	9
	557-577	ניתוח נתוני פאנל Panel Data Analysis Fixed and Random effects Models The Hausman test	10
		תרגול במעבדה	11
	748-751 776-780 796-808	ניתוח סדרות עיתיות ARMA, ARCH, GARCH קואינטגרציה Unit Root Processes	12
	474-479	The Generalized Method of Moments	13
		תרגול במעבדה	14

### ג. חובות הקורס:

דרישות קדם: סטטיסטיקה למנהע"ס

חובות / דרישות / מטלות: השתתפות בהרצאות ובתרגול המעשי

מרכיבי הציון הסופי (ציון מספרי / ציון עובר): 100% ציון בחינה

### ד. ביבליוגרפיה: (רשות/חובה)

**ספרי הלימוד (textbooks) וספרי עזר נוספים:**

William H. Greene, **Econometric Analysis** (Forth edition), **Prentice-Hall**

**חומר מחייב למבחנים:**

כל הנושאים שייסקרו בהרצאות ובתרגולי המעבדה