

שם ומספר הקורס: סטטיסטיקה ואקונומטריקה א' 9072000-35

סוג הקורס: הרצאה

שם המרצה: ד"ר קוזוקרו לוצי

שנת לימודים: תשע"ז סמסטר: א' היקף שעות: 2 ש"ס

דרכי התקשרות: [lutzy18@gmail.com](mailto:lutzy18@gmail.com)

אתר הקורס באינטרנט: בתוך אתר האינטרנט של המכללה.

**א. מטרות הקורס:**

להקנות כלים לבחינת קשרים כלכליים, לבחינת מודלים כלכליים בעזרת נתונים ולמתן תחזיות.

**ב. תוכן הקורס:**

הגרסיה עם משתנה מסביר אחד: אמידת הפרמטרים, תכונות האומדים, מדד לטיב התאמה, בדיקת השערות למודל, בדיקת השערות לפרמטרים, תחזית ורווח בר-סמך לתחזית. מודלים לא ליניאריים. מודל הרגרסיה הרב משתנית: אמידת הפרמטרים, מדדים לטיב התאמה, בדיקת השערות למודל, בדיקת השערות למקדמים, בדיקת השערות להשפעה משותפת ולצירופים לינאריים של מספר מקדמים

**מהלך השיעורים:**

הרצאות פרונטאליות תוך שימוש במצגות

**תכנית הוראה:**

מס' השיעור	נושא השיעור	קריאה נדרשת	הערות
1	מודל הרגרסיה הליניארית הפשוטה: אמידת הפרמטרים	1. א, 1. ב, 2. א, 1. ג	
2	הצגת המודל וההנחות הקלאסיות. תכונות האומדים ומשפט גאוס-מרקוב	1. ב, 1. ג, 2. ב, 1. ג	
3-4	מדד לטיב התאמה ובדיקת השערות למודל. בדיקת השערות לפרמטרים (מקדמים)	1. ג, 1. ג, 2. ג, 3. ג	שילוב עבודה ב SPSS
5	תחזית רווח בר-סמך לתחזית	1. ד, 1. ד, 2. ד	

המכללה האקדמית אשקלון

מס' השיעור	נושא השיעור	קריאה נדרשת	הערות
6	מודל לוג-לינארי מודל לינארי- לוגריתמי	2 א.2, 1א.2 2 ב.2, 1ב.2	שילוב עבודה ב SPSS
7	מודל לוגריתמי כפול מודל ריבועי	2 ג.2, 1ג.2 2 ד.2, 1ד.2	שילוב עבודה ב SPSS
8	מודל הרגרסיה הרב משתנית הצגת המודל ואמידת הפרמטרים	3 א.3, 1א.3, 3 א.3	שילוב עבודה ב SPSS
9	מדדים לטיב התאמה	3 ב.3, 1ב.3, 3 ב.3, 3ב.4	שילוב עבודה ב SPSS
10-11	בדיקת השערות למודל. בדיקת השערות למקדמים	3 ג.3, 1ג.3, 2ג.3, 3 ג.4	שילוב עבודה ב SPSS
12	בדיקת השערות לצירופים לינאריים של מספר מקדמים - מבחן Wald	3 ג.3, 1ג.3, 2ג.3, 3 ג.4	שילוב עבודה ב SPSS
13	סיכום רגרסיה רבת משתנים. בחירת המודל הטוב ביותר		שילוב עבודה ב SPSS

**ג. חובות הקורס:**

חובה להגיש 75% מתרגילי הבית. התרגילים יינתנו מתוך החוברת הנמצאת באתר האינטרנט של הקורס.

חובת נוכחות בשיעור.

בחינה מסכמת.

**דרישות קדם:**

ציון "עובר" (60 לפחות) בקורסים "סטטיסטיקה לכלכלנים" א' + ב'.

**מרכיבי הציון הסופי:**

בחינה מסכמת שמשקלה 100% מהציון.

הערה: סיום בהצלחה של הקורס מותנה בציון 60 לפחות בבחינה מסכמת.

**ד. ביבליוגרפיה:**

**1. מודל הרגרסיה הליניארית הפשוטה:**

**א. אמידת הפרמטרים**

1. Ramanathan, R. (2002). *Introductory econometrics with applications* (5<sup>th</sup> ed), South-Western. pp 76 - 85.
  2. שמואלי, ע., קיס, מ., בן-דוד, נ. (2002). *מושגי יסוד באקונומטריקה*, כרך א. תל אביב: האוניברסיטה הפתוחה. עמ' 28 - 51.
  3. שלפר, ד., חנוך, ג. (1995). *מבוא לאקונומטריקה*. תל-אביב: דיונון. עמ' 49 - 56.
- ב. הצגת המודל וההנחות הקלאסיות. תכונות האומדים ומשפט גאוס-מרקוב
  1. Ramanathan, R. (2002). *Introductory econometrics with applications* (5<sup>th</sup> ed), South-Western, pp 85- 90.
    2. שמואלי, ע., קיס, מ., בן-דוד, נ. (2002). *מושגי יסוד באקונומטריקה*, כרך א. תל אביב: האוניברסיטה הפתוחה. עמ' 115 - 136.
    3. שלפר, ד., חנוך, ג. (1995). *מבוא לאקונומטריקה*. תל-אביב: דיונון. עמ' 57 - 63.
  - ג. מדד לטיב התאמה ובדיקת השערות למודל. בדיקת השערות לפרמטרים (מקדמים)
    1. Ramanathan, R. (2002). *Introductory econometrics with applications* (5<sup>th</sup> ed), South-Western, pp 91 - 104.
      2. שמואלי, ע., קיס, מ., בן-דוד, נ. (2002). *מושגי יסוד באקונומטריקה*, כרך א. תל אביב: האוניברסיטה הפתוחה. עמ' 52 - 57, עמ' 137-146, 189 - 222.
      3. שלפר, ד., חנוך, ג. (1995). *מבוא לאקונומטריקה*. תל אביב: דיונון. עמ' 63 - 71.
  - ד. תחזית רווח בר-סמך לתחזית.
    1. Ramanathan, R. (2002). *Introductory econometrics with application* (5<sup>th</sup> ed), South-Western, pp 110 - 112.
      2. שמואלי, ע., קיס, מ., בן-דוד, נ. (2002). *מושגי יסוד באקונומטריקה*, כרך א'. תל אביב: האוניברסיטה הפתוחה. עמ' 223 - 245.

**2. מודלים לא ליניאריים:**

א. מודל לוג-לינארי

ב. מודל ליניארי-לוגריתמי

ג. מודל לוגריתמי כפול

ד. מודל ריבועי

1. Ramanathan, R. (2002). *Introductory econometrics with applications* (5<sup>th</sup> ed), South-Western, pp 235 - 256.

2. שלפר, ד., חנוך, ג. (1995). *מבוא לאקונומטריקה*. תל אביב: דיונון. עמ' 71 - 76.

**3. מודל הרגרסיה הרב משתנית**

א. הצגת המודל ואמידת הפרמטרים (מקדמים)

1. Ramanathan, R. (2002). *Introductory econometrics with applications* (5<sup>th</sup> ed), South-Western, pp 144 - 146.

2. שמואלי, ע., קיס, מ., בן-דוד, נ. (2002). *מושגי יסוד באקונומטריקה*, כרך א. תל אביב: האוניברסיטה הפתוחה. עמ' 277 - 307.

3. שלפר, ד., חנוך, ג. (1995). *מבוא לאקונומטריקה*. תל אביב: דיונון. עמ' 85 - 88.

ב. מדדים לטיב התאמה

1. Ramanathan, R. (2002). *Introductory econometrics with applications* (5<sup>th</sup> ed), South-Western, pp 148-151.

2. שמואלי, ע., קיס, מ., בן-דוד, נ. (2002). *מושגי יסוד באקונומטריקה*, כרך א. תל אביב: האוניברסיטה הפתוחה, עמ' 308 - 313.

3. קיס, מ., בן-דוד, נ., שמואלי, ע. (2002). *מושגי יסוד באקונומטריקה*, כרך ב. תל אביב: האוניברסיטה הפתוחה. עמ' 72 - 84.

4. שלפר, ד., חנוך, ג. (1995). *מבוא לאקונומטריקה*. תל אביב: דיונון. עמ' 89-92.

ג. בדיקת השערות למודל. בדיקת השערות למקדמים. בדיקת השערות להשפעה משותפת ולצירופים לינאריים של מספר מקדמים - מבחן Wald

1. Ramanathan, R. (2002). *Introductory econometrics with applications* (5<sup>th</sup> ed), South-Western, pp 153-162.
2. שמואלי, ע., קיס, מ., בן-דוד, נ. (2002). *מושגי יסוד באקונומטריקה*, כרך א. תל אביב: האוניברסיטה הפתוחה. עמ' 374 – 400.
3. קיס, מ., בן-דוד, נ., שמואלי, ע. (2002). *מושגי יסוד באקונומטריקה*, כרך ב. תל אביב: האוניברסיטה הפתוחה. עמ' 58 – 63.
4. שלפר, ד., חנן, ג. (1995). *מבוא לאקונומטריקה*. תל אביב: דיונון. עמ' 92 – 97.

## המכללה האקדמית אשקלון