

אקונומטריקה יישומית

מרצה: פרופ' אלמה כהן
מתרגל: מר. מתן גיבסון

מטרת הקורס: הקורס נועד להעמיק את ההבנה היישומית של אקונומטריקה, תוך פיתוח יכולת לניתוח ביקורתי של מאמרים אמפיריים, היכרות עם אסטרטגיות לזיהוי קשרים סיבתיים, והעמקת המיומנות בתכנות ויישום כלים אמפיריים ב-R על נתונים אמיתיים ממאמרים. הקורס מהווה המשך ישיר לקורס "מבוא לאקונומטריקה", ומתבסס על התיאוריה שנלמדה בו.

בשונה מקורס המבוא שהתמקד בעיקר בהיבטים התיאורטיים, הקורס הנוכחי שם דגש על הפן היישומי: כיצד עושים בפועל שימוש בכלים האקונומטריים לצורך ביצוע מחקר אמפירי, תוך למידת תכנים מתקדמים והעמקת ההבנה של תהליך המחקר הכלכלי.

הקורס עוסק בנושאים הבאים:

1. העמקת ההבנה של "הבעיה הבסיסית של הסקה סיבתית"
2. חזרה של שיטת הפרש ההפרשים (Diff-in-Diff)
3. רגרסיית אי-רציפות (Regression Discontinuity)
4. קריאה של מודרכת של מאמרים ודיון ביקורתי
5. העמקת הידע בתכנון ב-R

שיטת הלימוד: הקורס הוא בהיקף של 3 ש"ס, ויתקיים במתכונת מרוכזת של תשעה מפגשים בני שעתיים ורבע, שיחלו בשבוע החמישי של הסמסטר. במהלך הקורס נעמיק באסטרטגיות זיהוי סיבתיות, ולכל אסטרטגיה נקדיש שני מאמרים אמפיריים.

בנוסף, אחת לשבועיים יתקיים תרגול פרונטלי בן שעה וחצי, שבו המתרגל יעבור עם הסטודנטים על המאמרים שנלמדו בכיתה, וכן על פתרון התרגילים שמטרתם שחזור חלק מן הניתוחים שבוצעו במאמרים ובחינה ביקורתית של אסטרטגיות הזיהוי שנקטו בהם.

במהלך הקורס יידרשו הסטודנטים להעשות שימוש בשפת R, המשתמשת לעיבוד נתונים ולביצוע ניתוחים סטטיסטיים ואקונומטריים.

דרישות קדם:

מבוא לאקונומטריקה

דרישות הקורס:

במהלך הקורס ינתנו ארבעה תרגילים. בכל תרגיל יתבקשו הסטודנטים לקרוא מאמר אמפירי שהתפרסם בכתב עת מוביל בכלכלה, להבין את שאלת המחקר ותוצאותיו, לבחון כיצד החוקרים ניגשו לשאלה, באיזו מתודולוגייתזיהוי נעשה שימוש, מהי תקפותה המתודולוגית, ובאילו נתונים

השתמשו. כמו כן, הסטודנטים יתבקשו, בעזרת R, לשחזר חלק מתוצאות המאמר, ולבחון האם שינויים באופן ניתוח הנתונים עשויים להשליך על מסקנות המאמר.

הגשת התרגילים תעשה בזוגות. סטודנטים המעוניינים להגיש את התרגילים באופן עצמאי מתבקשים לקבל לכך אישור מהמרצה או מהמתרגל. יש למצוא שותף להכנת התרגילים עד השבוע השלישי של הקורס, שבו יינתן הנתרגיל הראשון, ולהודיע למתרגל מיהו השותף.

הרכב הציון הסופי:

- הציון הסופי יורכב מארבעת התרגילים שינתנו במהלך הסמסטר. הציון ייקבע בסוף הסמסטר על בסיס כלל התרגילים.
- **ציון סופי בקורס** – חובה 60 ומעלה.

אתר הקורס: אתר הקורס ב-Moodle

המאמרים שילמדו:

1. Baskaran, Thushyanthan, and Zohar Hessami (2018), "Does the Election of a Female Leader Clear the Way for More Women in Politics?," *American Economic Journal: Economic Policy*, Vol. 10(3), pp: 95-121
2. Cage, Julia, Caroline Le Pennec, and Elisa Mougin (2024), "Firm Donations and Political Rhetoric: Evidence from a National Ban," *American Economic Journal: Economic Policy*, Vol. 16(3), pp: 217-256
3. Gu, Yuqi, Connie X. Mao and Xuan Tian (2017) "Banks' Interventions and Firms' Innovation: Evidence from Debt Covenant Violations," *Journal of Law and Economics*, Vol 60(4), pp: 637-671
4. Holz, E. Justin, Roman G. Rivera, and Bocar A. Ba (2023), "Peer Effects in Police Use of Force," *American Economic Journal: Economic Policy*, Vol. 15(2), pp: 256-291

ספרות מומלצת לחזרה על הקורס מבוא לאקונומטריקה והעמקה בשיטות הזיהוי השונות:

1. Introductory Econometrics : a modern approach , Jeffrey M. Wooldridge
2. Introduction to Econometrics, Stock and Watson
3. Principles of Econometrics, Hill, Griffiths, and Lim
4. Mastering Metrics: The Path From Cause to Effect, Joshua D. Angrist & Jorn-Steffen Pischke
5. Basic Econometrics, Gujarati, Damodar N.

6. Econometric Models and Economic Forecast, Pindyck R.S., and Rubinfeld D.L