

Практическая эконометрика
4 курс, 7 семестр

Преподаватели:

Сучкова О. В., Картаев Ф. С., Калашнов Г. Ю. (аналитик Яндекс.Такси) при активном участии Лосевой Е. А (продуктовый аналитик tutu.ru), Геворкяна А. А. (ЭФ'17, Chicago)

Осенью 2018 в рамках курса предполагается читать методы микроэконометрики.

Цель курса – познакомить студентов с техникой микроэконометрики, чтобы по окончании курса прослушавшие его были способны провести собственное исследование.

Приглашаем студентов, которые весной 2018 слушают курс эконометрики-2. Часть заданий необходимо будет выполнять в R.

Предварительный список тем:

1. Дизайн исследования, сэмплинг
2. Matching and Propensity Score Estimators
3. Local Treatment effect
4. Разрывная регрессия
5. Процедура Хекмана
6. Квантильная регрессия

Основная литература:

1. Angrist, Joshua, and Jorn-Steffen Pischke. (2008) Mostly Harmless Econometrics: An Empiricist's Companion. Princeton University Press
2. Cameron, Colin, and Pravin Trivedi (2005) Microeconometrics: Methods and Applications. Cambridge University Press.
3. Imbens, Guido W. and Donald B. Rubin. (2015) Causal Inference for Statistics, Social, and Biomedical Sciences. Cambridge University Press.
4. Train, Kenneth. (2009) Discrete Choice Methods with Simulation. Cambridge University Press.

Дополнительные полезные ссылки:

1. Angrist, Joshua, and Jorn-Steffen Pischke. (2014) Mastering Metrics
2. Hastie Trevor, Tibshirani Robert, Friedman Jerome. The Elements of Statistical Learning. Data Mining, Inference, and Prediction
<https://web.stanford.edu/~hastie/Papers/ESLII.pdf>
3. <https://kassensmetrics.weebly.com/> – блог «Семестр эконометрики без учебников»
4. <http://economics.ozier.com/econ626/> – курс по прикладной микроэконометрике Университете Мэридэна, осень 2016
5. <http://www.econometricgame.com/> – сайт EconometricGame с разбором кейсов.
6. Brett R. Gordon , Florian Zettelmeyer «A Comparison of Approaches to Advertising Measurement: Evidence from Big Field Experiments at Facebook»
http://www.kellogg.northwestern.edu/faculty/gordon_b/files/fb_comparison.pdf

Контрольные мероприятия – домашние работы двух типов:

1. Набор теоретических и эмпирических (в R) задач, эмпирика представляет собой симуляции либо работу с набором данных. Такой формат знаком студентам, посещавшим курс Дмитрия Архангельского в марте 2018 г
2. Анализ статей, предполагающий ответы, например, на такие вопросы:

Прочитайте статью «Х» и ответьте на вопросы:

Каков основной вопрос статьи? Почему он важен/интересен?

В чём состоят основные результаты статьи?

Какие данные использованы?

Рассмотрите Таблицу X, запишите спецификацию уравнения регрессии, которое следует оценить, чтобы получить оценку dif-in-dif (или какого-то другого метода)

Как авторы интерпретируют результат?

По какой причине контрольная переменная x включена в модель № 1?

Каковы предпосылки, лежащие в основе предлагаемой авторами стратегии оценивания?

Дайте комментарии (возможно, критические) к статье, которые обсуждались или не обсуждались в самом тексте статьи.