

МАКРОЭКОНОМЕТРИКА

Преподаватель: Шестаков Даниил Евгеньевич, ведущий экономист Банка России.

Место дисциплины в учебном плане: дисциплина по выбору, 4 триместр.

Цель освоения дисциплины: ознакомить слушателей с современным эконометрическим инструментарием моделирования макроэкономической динамики и дать практические навыки моделирования.

Краткое содержание дисциплины:

- Структурные модели макроэкономического прогнозирования.
- Эволюция макроэкономической теории и практико-ориентированных теоретических моделей.
- Одномерные модели: оценка и прогнозирование.
- Многомерные модели временных рядов: VAR.
- Многомерные модели временных рядов: байесовские VAR.
- Основы байесовской эконометрики.
- Условный прогноз.
- Многомерные модели временных рядов: факторные модели.
- Структурные модели временных рядов: шоки и фрикции в макроэкономических колебаниях; идентификация шоков политики, способы и ограничения; анализ импульсных функций отклика, разложение вариации и историческая декомпозиция.
- Сбор статистических данных для исследования: что, где, когда.

Общая трудоемкость дисциплины составляет 3 зачетные единицы, 108 часов.

Язык преподавания: русский.

Итоговый контроль по дисциплине проводится в форме письменной работы.