

ЭКОНОМЕТРИКА – 3 (продвинутый уровень)

ФИО преподавателя: доцент, к.э.н. Черняк Владимир Ильич

Место дисциплины в учебном плане: обязательная дисциплина, 1 триместр

Эконометрика – один из основных курсов (наряду с макро и микроэкономикой) для магистерской программы «Мировая экономика». В отличие от ознакомительных курсов бакалавриата, целью которых служило знакомство с математическими основами статистического и эконометрического анализа, в данном курсе центральным становится обучение прикладным методам и приемам исследования реальных экономических данных. Большой объем самостоятельной работы позволяет каждому закрепить основные методы и приемы на практике. Основную часть работы студенты изучают путем построения и анализа эконометрических моделей с помощью современных компьютерных программ, предназначенных для профессиональной работы экономиста. Акцент в курсе делается на содержательном смысле проблем, методов и подходов эконометрического анализа, практических приемах исследования данных и формулирования выводов. Основное внимание уделяется экономической интерпретации и приложениям рассматриваемых эконометрических моделей. Курс покрывает изучение всех типов данных, встречающихся в реальных задачах эконометрического анализа: от перекрестных выборок, до временных рядов и панельных данных.

Краткое содержание дисциплины: подготовка данных для эконометрического исследования и построение простейших эконометрических моделей, оценка качества парной регрессионной модели, преобразование переменных в парной регрессии, множественная регрессия, спецификация множественной регрессии: выбор переменных, выбор формы зависимости, эконометрическое оценивание моделей микро- и макро-экономики, пространственные выборки и гетероскедастичность, временные ряды и автокорреляция, стохастические переменные и эндогенность, фиктивные переменные, оценивание методом максимума правдоподобия, модели бинарного выбора, динамические модели, нестационарные временные ряды, эконометрическое моделирование, основанное на панельных данных.

Общая трудоемкость дисциплины составляет: 5 зачетные единицы, 180 часа.

Язык преподавания: русский.

Итоговый контроль по дисциплине проводится в форме контрольных работ.