

Практическая эконометрика

О курсе на осень 2020

Георгий Калашнов go9513@gmail.com
Ольга Сучкова suchkovaolga.91@mail.ru

О чём курс

Кому он может быть полезен?

На что похож курс?

Пререквизиты

Структура оценок и результаты анкетирования

Балльно-рейтинговая система

Список основной литературы

Контакты преподавателей

О чём курс

- ▶ Мы изучаем гетерогенный мир. Кому-то финансовая помощь помогает при обучении, а кому-то нет. Переезд семьи в благополучный район по программе расселения аварийного жилья может по-разному повлиять на будущее детей разного возраста и пола, их будущую занятость и участие в преступности.
- ▶ В рамках курса мы будем говорить о гетерогенных оценках и методах, которые помогают измерить размер такого воздействия и которые позволяют получить подобие эксперимента там, где эксперимента нет. Что-то вы уже о них знаете из курсов Поведенческой и экспериментальной экономики и Эконометрики-2).

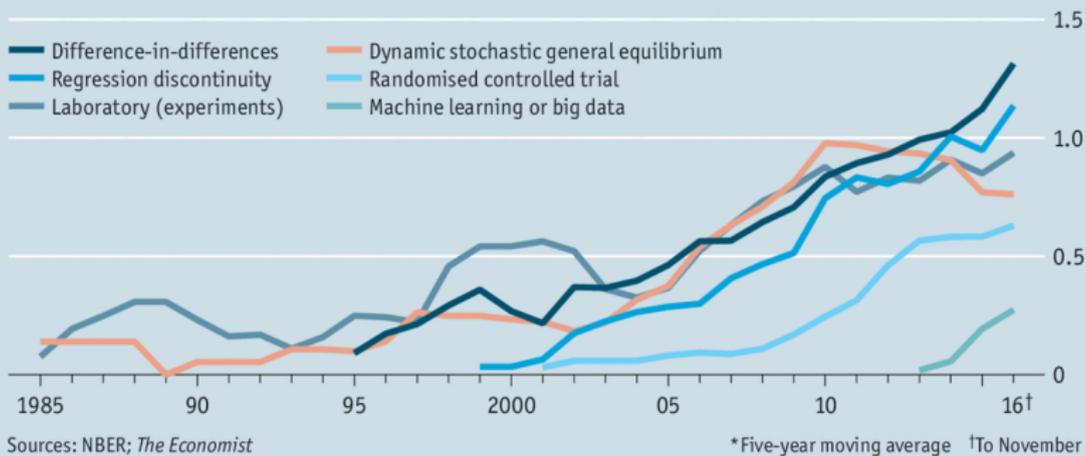
Кому он может быть полезен?

- ▶ Тем, кто собирается заниматься анализом данных в отрасли или продолжать учиться в магистратуре/аспирантуре.
- ▶ Полезно разбираться в подобных методах, если вы хотите заниматься policy advice - помочь органам власти оценить эффекты от реформ в регионах, или видите себя продуктовым аналитиком, который проводит АБ-тесты для воронки продаж.
- ▶ Если вы интересуетесь академическими исследованиями - нужно понимать и применять методы из современных эмпирических статей.

Доля исследований с методами causal inference растёт: (The Economist по аннотациям препринтов на NBER)

Dedicated followers of fashion

Mentions in NBER working-paper abstracts, % of total papers*



Sources: NBER; *The Economist*

*Five-year moving average †To November

На что похож курс?

- ▶ Сокращённая версия читалась на МФК «Причины и следствия: как экономисты пытаются данные» весной 2020 года. Презентации и материалы доступны по ссылке:

https://github.com/go95/mfk_causal_inference

- ▶ Курсы по прикладной микроэконометрике и/или оценке причинно-следственных связей в западных университетах (Стэнфорд, Нью-Йорк, Мэриленд, SEMFI-Мадрид, Лунд и т.д.), а в России также в магистратуре РЭШ и совместном бакалавриате.
- ▶ На экономическом факультете МГУ в 2014 (видео, программа) и 2018 (видео, программа) про оценку причинно-следственных связей рассказывал Дмитрий Архангельский (ЭФ'2010, PhD Stanford)

Пререквизиты

- ▶ Навыки программирования в R
- ▶ Английский язык для чтения статей
- ▶ Базовые знания эконометрики и матстатистики

Что ещё стоит знать о курсе?

Структура оценок за экзамен в 2018 (53 чел) и 2019 (54 чел)

отлично – 59,6% и 40,7% , хорошо – 32,8% и 40,7%,
удовлетворительно – 3,8% и 11,1%, неудовлетворительно –
3,8% и 7,5%.

Результаты анкетирования студентов 2018 и 2019:

Сводная оценка курса: 4.27 и 3.82

Содержательность и полезность: 4.25 и 3.79

Организация самостоятельной работы: 4.50 и 4.18

Качество лекций: 4.46-4.61 и 3.90-4.44

Качество семинаров: 4.25-4.35 и 4.38-4.39

Балльно-рейтинговая система

- ▶ Несколько больших практических домашних заданий (в том числе репликация статей), которые будут составлять большую часть оценки (60%). Плюс сложные бонусные пункты, за которые можно получить баллы за пределами 60%.
- ▶ Экзамен – 40% от курса.
- ▶ Критерии оценок: отлично — не менее 80%, хорошо — не менее 60%, удовлетворительно — не менее 40%

Список основной литературы

Angrist, J. D., Pischke, J.-S. (2009). Mostly harmless econometrics: An empiricist's companion. Princeton: Princeton University Press.

Imbens, G., Rubin, D. (2015). Causal Inference for Statistics, Social, and Biomedical Sciences: An Introduction. Cambridge: Cambridge University Press. doi:10.1017/CBO9781139025751

Gerber, A. S., Green D. P. (2012) Field Experiments: Design, Analysis, and Interpretation.

Abadie (2018) Econometric Methods for Program Evaluation. doi.org/10.1146/annurev-economics-080217-053402

Hastie T., Tibshirani R. and Friedman J. (2017) The Elements of Statistical Learning.

<http://web.stanford.edu/~hastie/ElemStatLearn/>

Пишите - ответим на вопросы!

- ▶ Калашнов Георгий (ЭФ МГУ, Яндекс)
go9513@gmail.com
- ▶ Сучкова Ольга (ЭФ МГУ, ИПЭИ РАНХиГС)
suchkovaolga.91@mail.ru