

## ИЗБРАННЫЕ АСПЕКТЫ ЭКОНОМЕТРИКИ

Лектор: Станислав Анатольев

Ассистент: Сергей Головань

Российская экономическая школа, Москва

Данный семинар освещает некоторые технические и методологические вопросы современной эконометрики. Технические вопросы касаются инструментария современной эконометрики и ориентируются в основном на работу с временными рядами и панельными данными. Среди методологических будут рассмотрены такие вопросы, как организация научной деятельности, что такое теоретические, прикладные и эмпирические исследования, надлежащее оформление эконометрических работ и процесс публикации исследований в научных журналах. Курс также ориентируется на формирование практических навыков работы со статистическими пакетами типа *Econometric Views*.

### ПРОГРАММА

День 1.

Лекции: Некоторые вопросы научной деятельности и методология эконометрических исследований. Статистические основы современной эконометрики. Обзор линейного регрессионного анализа и метода наименьших квадратов. Оценки наименьших квадратов, оценивание их дисперсии.

Практика: Начало работы с *Econometric Views*. Метод наименьших квадратов.

День 2.

Лекции: Структурные и неструктурные модели. Выбор неструктурной модели и объекта динамического моделирования. Стационарные переменные и переменные с единичным корнем. Тренды и случайные блуждания.

Тестирование на единичные корни. Линейные авторегрессии. Прогнозирование.

Практика: Тестирование на единичные корни. Построение линейной авторегрессии.

День 3.

Лекции: Векторные авторегрессии. Нелинейные регрессионные модели.

Нелинейный метод наименьших квадратов. Пороговая авторегрессия и авторегрессия с гладкими переходами.

Практика: Векторная авторегрессия. Построение пороговой и других нелинейных авторегрессий.

День 4.

Лекции: Линейные модели с инструментальными переменными и инструментальные оценки. Нелинейные модели, метод максимального правдоподобия и обобщённый метод моментов. Тестирование спецификации.

Практика: Инструментальные оценки и обобщённый метод моментов.

День 5.

Лекции: Панельные данные и их специфика. Статические панельные регрессии, оценивание «внутри». Динамические панельные регрессии, оценивание с «первыми приращениями». Нелинейные модели на панельных данных.

Практика: Работа с моделями панельных данных в *Econometric Views*.

#### ПОЛЕЗНАЯ ЛИТЕРАТУРА

Журнал *Квантиль*: «Оформление эконометрических отчётов» (№4), «Где найти данные в сети?» (№6), «Мини-словарь англоязычных эконометрических терминов» (№№3,5), «Введение в прогнозирование в классических моделях временных рядов» (№1), «Выбор модели и парадоксы прогнозирования» (№1), «Экскурс в мир инструментальных переменных» (№2), «Инструментальные переменные и эндогенность: нетехнический обзор» (№2)

Анатольев, С. (2003, 2006) «Курс лекций по эконометрике для продолжающих», «Курс лекций по эконометрике для подготовленных», Российская Экономическая Школа

Hayashi, F. (2000) *Econometrics*, Princeton University Press

Enders, W. (2004) *Applied Econometric Time Series*, John Wiley, 2nd edition

Franses, P. and D. van Dijk (2000) *Nonlinear Time Series Models in Empirical Finance*, Cambridge

Baltagi, B. (1995, 2001, 2005) *Econometric Analysis of Panel Data*, John Wiley & Sons