

Российская экономическая школа

РЭШ во ВШЭ: Эконометрика

Преподаватели: Станислав Анатольев, Анатолий Пересецкий

Основная задача курса – дать слушателю ориентиры для построения учебных программ и проведения эмпирических исследований в русле текущего состояния эконометрической науки. Курс представляет из себя набор тем, важных с точки зрения современного прикладного эконометрического анализа. Помимо лекций, планируются практические семинары с использованием пакета *Econometric Views*. Материал будет сопровождаться как фрагментами учебников и монографий методологического плана, так и иллюстрирующими прикладными статьями.

Лекция 1. Модели бинарного выбора.

- Verbeek M. (2008). *A guide to modern econometrics*, 3th ed., Ch. 7.1.
- Пересецкий А.А. Методы оценки вероятности дефолта банков. *Экономика и математические методы*, 2007, №3, 37-62.

Лекция 2. Модели упорядоченного множественного выбора.

- Verbeek M. (2008). *A guide to modern econometrics*, 3th ed., Ch. 7.2.
- Пересецкий А.А., Карминский А.М., ван Суст А.Г.О. Модели рейтингов банков. *Экономика и математические методы*, 2004, №4, 10-25.
- Пересецкий А.А. Измерение компоненты внешней поддержки рейтингов агентства Moody's. *Прикладная эконометрика*, 2009, №2, 3-23.

Лекция 3. Методы максимального правдоподобия и квазиправдоподобия

- White, H. Maximum Likelihood Estimation of Misspecified Models. *Econometrica*, 1982, vol. 50, pp. 1–25.

Лекция 4. Обобщенный метод моментов

- Hansen, B.E. and K.D. West. Generalized Method of Moments and Macroeconomics. *Journal of Business & Economic Statistics*, 2002, vol. 20, pp. 460–469.
- Jagannathan, R., Skoulakis, G. and Z. Wang. Generalized Method of Moments: Applications in Finance. *Journal of Business & Economic Statistics*, 2002, vol. 20, pp. 470–481.

Лекция 5. Модели множественного выбора.

- Verbeek M. (2008). *A guide to modern econometrics*, 3th ed., Ch. 7.2, 7.3.
- Cameron A.C., Trivedi P.K. (2005) *Microeconometrics*, Ch. 15.

Лекция 6. Модели с урезанными и цензурированными выборками.

- Verbeek M. (2008). *A guide to modern econometrics*, 3th ed, Ch. 7.4, 7.5, 7.6.
- Cameron A.C., Trivedi P.K. (2005) *Microeconometrics*, Ch. 16.

Лекция 7. Принципы моделирования временных рядов

- Hansen, B.E. Discussion of 'Data mining reconsidered. *Econometrics Journal*, 1999, vol. 2, pp. 192–201
- Qi, Min. Nonlinear predictability of stock returns using financial and economic variables. *Journal of Business & Economic Statistics*, 1999, vol. 17, pp. 419–429

Лекция 8. Структурная нестабильность в эконометрических моделях

- Фрагменты учебников и монографий
- Papell, D.H., C.J. Murray, & H. Ghiblawi. The structure of unemployment. *Review of Economics and Statistics*, 2000, vol. LXXXII, pp. 309–315

Лекция 9. Нелинейные модели временных рядов

- Franses, P. and D. van Dijk. *Nonlinear Time Series Models in Empirical Finance*, Cambridge, 2000, Глава 3
- Hansen, Bruce E. Inference in TAR models. *Studies in Nonlinear Dynamics and Econometrics*, 1997, vol. 2, pp. 1–14

Лекция 10. Волатильность

- Franses, P. and D. van Dijk. *Nonlinear Time Series Models in Empirical Finance*, Cambridge, 2000, Глава 4
- Hsieh, D.A. Modeling heteroscedasticity in daily exchange rates. *Journal of Business & Economic Statistics*, 1989, vol. 7, pp. 307–317