

# ПРИКЛАДНАЯ ЭКОНОМЕТРИКА

Лектор: Станислав Анатольев  
Российская экономическая школа, Москва

Курс прикладной эконометрики ориентируется на прикладной анализ временных рядов применительно к макроэкономическим и панельным данным и формирование практических навыков работы со статистическими пакетами типа Econometric Views.

## ПРОГРАММА

День 1.

Лекции: Линейные модели на временных рядах регрессионного типа. Оценки наименьших квадратов, оценивание их дисперсии, тестирование статистических гипотез.

Практика: Начало работы с Econometric Views. Метод наименьших квадратов. Приложение к тестированию несмещённости и информативности прогнозов процентной ставки инфляции (модели Мишкина и Хансена-Ходрика)

День 2.

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

Практика: Инструментальные оценки и обобщённый метод моментов. Приложение к новокейнсианской кривой Филипса и модели С-САРМ (модели Хансена-Синглтона и Ферсона-Константинидеса).

День 3.

Лекции: Стационарные переменные и переменные с единичным корнем. Тренды и случайные блуждания. Тестирование на единичные корни. Линейные авторегрессии. Прогнозирование. Векторные авторегрессии.

Практика: Построение линейной авторегрессии для ВВП. Тестирование паритета покупательной способности. Векторная авторегрессия для пары «деньги»-«цены».

День 4.

Лекции: Нелинейные регрессионные модели. Пороговая авторегрессия и авторегрессия с гладкими переходами.

Практика: Построение пороговой авторегрессии для ВВП. Построение авторегрессии с гладкими переходами для серий производства и потребления.

День 5.

Лекции: Панельные данные и их специфика. Статические панельные регрессии, оценивание «внутри». Динамические панельные регрессии, оценивание «первымиращениями».

Практика: Работа с моделями панельных данных в Econometric Views. Приложение к оцениванию производственной функции, к модели предложения труда, к модели сходимости роста.