

АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ

Прикладная эконометрика

Автор: Картаев Ф.С.

Код и наименование направления подготовки, профиля: 38.04.01 Экономика («Экономика и финансы»)

Квалификация (степень) выпускника: Магистр

Форма обучения: очная

Цель освоения дисциплины:

Углубить компетенции в сфере аналитической работы в области экономики и финансов, а также научно-исследовательской работы.

План курса:

Тема 1. Введение в дизайн экспериментов и оценку эффектов воздействия

Эксперименты и квазиэксперименты в эконометрике. Моделирование эффекта воздействия (treatment effect). Внешняя и внутренняя валидность результатов эконометрического моделирования. Оценка эффекта воздействия на примере работы Kreuger (1999) Experimental Estimates of Education Production Functions // The Quarterly Journal of Economics.

Тема 2. Оценка эффекта воздействия при помощи инструментальных переменных

Применение методов, основанных на инструментальных переменных, для оценки эффекта воздействия на примере работ: Acemoglu, Daron, Simon Johnson and James A. Robinson. The Colonial Origins of Comparative Development: An Empirical Investigation, American Economic Review, 2001, vol. 91(5); Atif Mian & Amir Sufi. House Prices, Home Equity-Based Borrowing, and the US Household Leverage Crisis, American Economic Review, 2011, vol. 101(5); Angrist, J.D., and Evans, W.N. (1998). Children and Their Parents' Labor Supply: Evidence from Exogenous Variation in Family, Size American Economic Review, 88, 450–477.

Тема 3. Оценка эффекта воздействия на основе метода разность разностей

Оценка метода разность разностей (difference in difference estimator) и его обобщения. Оценка эффекта воздействия при помощи метода разность-разностей на примере работ: Card and Kreuger (1994), Minimum Wages and Employment: A Case Study of the Fast-Food Industry in New Jersey and Pennsylvania // American Economic Review

Тема 4. Оценка эффекта воздействия на основе разрывного регрессионного дизайна

Разрывный регрессионный дизайн (regression discontinuity design). Четкий и нечеткий разрывный дизайн. Реализация на примере работ: David S. Lee (2008), Randomized Experiments from Non-random Selection in U.S. House Elections, Journal of Econometrics, 142(2) 675-697;

Контактные часы: 16

Формы текущего контроля и промежуточной аттестации: домашнее задание, зачет.

Этап освоения компетенции	Показатель оценивания	Критерий оценивания
ПК-9.У	способен анализировать и составлять прогноз основных социально-экономических показателей деятельности предприятия, отрасли, региона используя панельные и пространственные данные	понимает и объясняет эконометрические модели, выбирает и обосновывает применение моделей в зависимости от условий, проводит самостоятельные расчеты

Основная литература:

1. Кэмерон, Э. Колин; Триведи Правин К. Микроэконометрика: методы и их применение. — М.: Издательский дом «Дело», РАНХиГС, 2015.

2. Angrist and Pischke, Mostly harmless econometrics. —Princeton University Press, 2009