

# АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ

Б1.В.09 Прикладная эконометрика

(наименование дисциплины)

**Автор:** Бесстремьянная Г.Е.

**Код и наименование направления подготовки, профиля:** 38.04.01 Экономика («Цифровая экономика»)

**Квалификация (степень) выпускника:** магистр

**Форма обучения:** очная

**Цель освоения дисциплины:** сформировать компетенции в сфере аналитической работы в области экономики и финансов, обработки и анализа данных, а также проектно-аналитической работы.

## План курса:

Блок 1. Парная и множественная регрессия, проверка статистических гипотез

Тема 1. Парная и множественная регрессия

Тема 2. Проверка статистических гипотез

Блок 2. Метод инструментальных переменных

Тема 3. Эндогенность в регрессии, валидность и релевантность инструментов

Тема 4. Репликация оценивания методом инструментальных переменных в научных статьях и статистики первого шага.

Блок 3. Панельная регрессия: линейные и обобщенные линейные модели

Тема 5. Линейная модель панельной регрессии

Тема 6. Обобщенные линейные модели, семейства распределений

Блок 4. Учет гетерогенности в панельной регрессии

Тема 7. Пороговые регрессии (threshold regression).

Тема 8. Регрессии с расщеплением смеси распределений (finite mixture models) для линейных моделей и моделей с дискретной зависимой переменной.

Тема 9. Квантильные регрессии

Блок 5. Панельные модели бинарного и множественного выбора. Цензурированные и урезанные выборки

Тема 10. Панельные модели бинарного и множественного выбора

Тема 11. Цензурированные и урезанные выборки

Тема 12. Выбор спецификации для прикладных исследований с панельными данными.

**Объем дисциплины:** 3 ЗЕ (108 ак.ч./81 астр.ч.). Из них: количество академических часов, выделенных на контактную работу обучающихся с преподавателем (по видам учебных занятий) – 24 ак.ч.; на самостоятельную работу обучающихся – 80 ак.ч.

**Формы текущего контроля и промежуточной аттестации:** домашние задания (ДЗ), итоговая контрольная работа (КР), зачет.

## Основная литература:

1) Эконометрика (продвинутый курс). Применение пакета Stata : учебное пособие для вузов / Е. С. Вакуленко, Т. А. Ратникова, К. К. Фурманов. — Москва : Издательство Юрайт, 2020. — 246 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-12244-  
<https://urait.ru/book/ekonometrika-prodvinutyy-kurs-primenenie-paketa-stata-447095>.