

## Эконометрика-3

**Преподаватель:** к.э.н., доцент Картаев Филипп Сергеевич, кафедра математических методов анализа экономики ЭФ МГУ.

**Цель освоения дисциплины:**

научиться осуществлять исследования с использованием эконометрических методов продвинутого уровня.

**Краткое содержание дисциплины:**

- ❖ Вводная часть: подходы и проблемы исследования причинно-следственных связей при помощи эконометрических методов; повторение базовых методов оценивания на пространственных данных (OLS, TSLS и необходимые статистические тесты).
- ❖ Модели дискретного множественного выбора; модели на панельных данных: статические (FE, RE) и динамические модели (GMM).
- ❖ Дизайн экспериментов и оценка эффекта воздействия (treatment effect): метод разность разностей, сопоставление и мер склонности (Propensity Score Matching), разрывный дизайн.
- ❖ Структурные векторные авторегрессионные модели (SVAR).

**Общая трудоемкость дисциплины** составляет 5 зачетных единиц, 180 часов.

**Итоговый контроль** по дисциплине проводится в форме экзамена.