

Утверждена  
Академическим советом ООП  
Протокол № 05.1-18/19 от  
25.06.2019

## Программа дисциплины

### Эконометрика

Автор	Борис Демешев, старший преподаватель кафедры математической экономики и эконометрики, департамент прикладной экономики. НИУ ВШЭ
Число кредитов	4
Контактная работа (час.)	0
Самостоятельная работа (час.)	152
Курс	1
Формат изучения дисциплины	blended

#### О курсе

Эконометрика – наука, позволяющая исследовать закономерности в реальных данных. К концу курса мы научимся отвечать на два вопроса. Как одна переменная,  $y$ , зависит от другой переменной,  $x$ ? Как спрогнозировать переменную  $y$ ?

Мы будем подробно изучать линейные регрессионные модели, рассмотрим наиболее частые отклонения от предпосылок классической линейной регрессии. Изучим базовые модели (логит и пробит) для качественных зависимых переменных. Наряду с теоретической основой мы будем работать с реальными данными, используя статистический пакет R.

#### Необходимые знания:

Теория вероятностей и математическая статистика.

Линейная алгебра опционально.

#### Программа курса

Неделя 1. Метод наименьших квадратов или рабочая лошадка эконометриста, введение в R.

Неделя 2. Статистические свойства оценок коэффициентов.

Неделя 3. Дамми-переменные, сравнение вложенных моделей

Неделя 4. Мультиколлинеарность

Неделя 5. Гетероскедастичность

Неделя 6. Автокорреляция

Неделя 7. Метод максимального правдоподобия. Модели бинарного выбора

Неделя 8. Стационарные временные ряды

Неделя 1. Эндогенность

Неделя 1. Нестандартные сюжеты

### **Формирование итоговой оценки за онлайн дисциплину**

Итоговая оценка за дисциплину формируется следующим образом:

**Оитоговая. = 0,8• Отекущий + 0,2 • Оэкз.**

где 0,8 и 0,2 – удельные веса.

Отекущая – накопленная оценка за онлайн курс

Оэкз – оценка за оффлайн экзамен

### **Программное обеспечение**

<b>№ п/п</b>	<b>Наименование</b>	<b>Условия доступа</b>
1.	Microsoft Windows 7 Professional RUS Microsoft Windows 10 Microsoft Windows 8.1 Professional RUS	<i>Из внутренней сети университета (договор)</i>
2.	Microsoft Office Professional Plus 2010	<i>Из внутренней сети университета (договор)</i>

### **Профессиональные базы данных, информационные справочные системы, интернет-ресурсы (электронные образовательные ресурсы)**

<b>№ п/п</b>	<b>Наименование</b>	<b>Условия доступа</b>
	<b><i>Профессиональные базы данных, информационно-справочные системы</i></b>	
1.	Консультант Плюс	<i>Из внутренней сети университета (договор)</i>
3.	Гарант	<i>Из внутренней сети университета (договор)</i>
	<b><i>Интернет-ресурсы (электронные образовательные ресурсы)</i></b>	
1.	Курсера	URL: <a href="https://ru.coursera.org/">https://ru.coursera.org/</a>

### **Материально-техническое обеспечение дисциплины**

Учебные аудитории для самостоятельных занятий по дисциплине оснащены ПЭВМ с возможностью подключения к сети Интернет и доступом к электронной информационно-образовательной среде НИУ ВШЭ.