

Микроэконометрика

4 модуль, 2025-2026

Ольга Кузьмина

Российская экономическая школа

okuzmina@nes.ru

Ассистент преподавателя (семинары): Гумай Магомедова

gmagomedova@nes.ru

Ассистент преподавателя (грейдер): Елена Шарова

esharova@nes.ru

Описание курса

Чтобы принимать стратегические решения и давать рекомендации по политике, людям, бизнесу и государствам необходимо понимать, как эти решения влияют на их полезность, прибыль, благосостояние. Каузальный вывод позволяет извлекать такие инсайты из данных. В данном курсе мы начнем с «экспериментального идеала» (А/В-тестирования). Так как активное проведение экспериментов не всегда возможно и часто приходится использовать уже существующие наблюдательные данные для формулирования выводов, мы рассмотрим наиболее популярные альтернативные стратегии, позволяющие осуществлять каузальную идентификацию при определённых предположениях. Цель курса – помочь студентам понять современные прикладные эконометрические методы, научиться интерпретировать и критически оценивать эмпирические статьи, а также развить навыки, необходимые для планирования и реализации собственных проектов в области анализа данных. Предполагается, что студенты уже обладают достаточными знаниями базовой эконометрической теории.

Требования курса, система оценивания, посещаемость

Система оценивания:

Итоговая оценка по курсу будет складываться из:

- 2 домашних заданий (по 10% каждое),
- двух кейсов (7% – письменная работа дома + 3% – очное обсуждение каждого),
- итогового экзамена в аудитории (60%).

Экзамен будет включать вопросы по эмпирической статье, выданной заранее (см. раздел *Примеры заданий*).

Политика по домашним заданиям:

Домашние задания загружаются в электронном виде на портал *tu.nes.ru*. Просроченные работы снижаются на 10% за каждый день задержки (настоятельно не рекомендуется сдавать позже срока, так как в течение модуля будет много работы, и наверстать будет сложно).

Все домашние задания являются групповыми. Обсуждение возможно внутри группы, но не между группами. Для выполнения заданий необходимо сформировать группу из 3–4 человек к концу второй недели курса и отправить ассистенту преподавателя письмо с составом группы. Выбирайте участников ответственно – «фрирайдеры» могут осложнить работу. Если возникают трудности с поиском группы – обратитесь к ассистенту как можно скорее.

Политика по кейсам:

Кейсы строятся на статьях, которые необходимо прочитать заранее. Заранее будет известно, какие статьи обсуждаются для начисления баллов и в какие даты.

Письменная часть – это индивидуальное задание, выполняемое дома (базовые вопросы по статье), которое необходимо сдать до лекции, на которой обсуждается кейс.

Разрешается обсуждать статью с однокурсниками, но списывать ответы запрещено.

Устная часть – 15-минутное обсуждение в классе; 3 содержательных ответа обеспечивают получение максимального балла за обсуждение данного кейса.

Прочее:

Отношение – ключевой фактор. Придерживайтесь зрелой, профессиональной позиции.

Опоздания мешают проведению занятий – уважайте коллег.

Если часть занятий проводится онлайн, необходимо включать камеру и держать микрофон выключенным, когда вы не говорите.

Вся важная информация (включая лекции и задания) будет публиковаться на *my.nes.ru*.

Вы должны регулярно проверять портал.

Содержание курса

Каждая тема включает лекции и интерактивные обсуждения (например, обсуждение заранее прочитанной статьи). Список литературы будет выложен отдельно и будет обновляться по мере прохождения курса.

Предварительный план курса:

1. **Блок 1 [Л1–Л4]** Дизайн исследований. Подход потенциальных исходов. Рандомизированные эксперименты. *Экстерналии. *Рандомизированный вывод.

До Л3–Л4: сдача вопросов по Кейсу 1

Во время Л3–Л4: обсуждение Кейса 1 в классе

2. **Блок 2 [Л5–Л8]** Регрессия: агностическая и каузальная. Отбор по наблюдаемым. Смещение из-за пропущенных переменных и «плохих контролей». (Кратко:) Сопоставление. Методы на основе скоринговых функций. *Синтетический контроль.

После Л7–Л8: выдача группового задания 1

3. **Блок 3 [Л9–Л10]** Панельные данные. Оценки фиксированных эффектов и первых разностей. Фиксированные эффекты против случайных эффектов. *Ошибка измерения. *Проблема инцидентных параметров. Метод разностей-разностей. Нестандартные и стандартные ошибки.

До Л9–Л10: сдача вопросов по Кейсу 2

Во время Л9–Л10: обсуждение Кейса 2 в классе

4. **Блок 4 [Л11–Л12]** Инструментальные переменные. Гетерогенность и локальное среднее каузальное воздействие. *Слабые инструменты.

После Л11–Л12: выдача группового задания 2

5. **Блок 5 [Л13–Л14]** Дизайн регрессии с разрывом. Жёсткий против нечеткого разрыва. Интерпретация как IV.
(если хватит времени)

Методология

Лекции (14) + Занятия с ассистентами (5-6).

Примеры заданий

Вопросы связаны со статьей, раздаваемой за несколько дней до экзамена:

(a) Базовые вопросы:

(i) Каков основной исследовательский вопрос в статье? Является ли он важным/интересным и почему?

(ii) Каковы основные результаты статьи?

(iii) Какие данные использованы (срез, временной ряд, панель, повторные срезы и т.д.)?

(b) Стратегия DiD (спецификация регрессии (1), Таблицы 2 и 3):

(i) Рассмотрите коэффициент DiD = 0.027*** из Таблицы 2. Запишите спецификацию регрессии, которая дает данную оценку.

(ii) Как авторы интерпретируют эту оценку? Является ли она экономически значимой?

(iii) Зачем включать контрольные переменные X в спецификацию (1)?

(iv) Рассмотрите коэффициенты DiD в Таблице 3 (столбцы 1–4: от 0.019** до 0.009*).

Почему линейные/квадратичные тренды не включены в эти спецификации?

(v) Что авторы указывают в скобках под коэффициентами?

(c) Идентифицирующие предположения метода DiD:

(i) Какое предположение лежит в основе данной стратегии оценивания? Как авторы подтверждают его выполнение?

(ii) Предположим, что есть ненаблюдаемое различие между когортами 21-летних и 22-летних (например, более высокая вероятность окончания колледжа у старших),

напрямую влияющее на эмансипацию. Сделает ли это использование DiD некорректным?
(iii) Предположим, что одновременно с политикой субсидий на аренду правительство вводит другую программу для лиц 22–29 лет, неизвестную авторам. Повлияет ли это на интерпретацию результатов?

(iv) Учитывая критерии отбора (стр. 4–5 статьи), какой плацебо-тест можно провести, чтобы исключить это возражение?

Академическая этика

Списывание, плагиат и любые другие способы нарушения академической этики РЭШ недопустимы.