

Документ подписан простой электронной подписью  
Информация о владельце:  
ФИО: Суворов Антон Дмитриевич  
Должность: Ректор  
Дата подписания: 27.09.2023 13:13:31  
Уникальный программный ключ:  
a39bdb15d680d3b0adbfced0af5c1efb14747dc0

**УТВЕРЖДАЮ**  
Ректор А.Д. Суворов  
«3» июля 2023 г.

Протокол Совета программы  
«Магистр экономики»  
№ 70 от 29 июня 2023 г.

## **Аннотация рабочей программы дисциплины**

### **Прикладная макроэконометрика**

#### **Направление подготовки 38.04.01 Экономика**

#### **Программа «Магистр экономики»**

### **1. Цели и задачи дисциплины**

Целью этого курса является ознакомление студентов с рядом методов, используемых в прикладной микроэконометрике, с упором на проведение эмпирических исследований. Основное внимание в курсе будет уделяться практическим вопросам, которые возникают при работе с данными и использовании различных эконометрических методов. Задачей курса также является углубление у студентов понимания того, как теоретические концепции рассматриваются в прикладной эконометрической практике, а также развитие навыков работы с эконометрическим программным обеспечением.

### **2. Планируемые результаты**

В результате освоения дисциплины выпускник должен:

**знать** основные методы эконометрического анализа, основные их характеристики, свойства и ограничения; знать подходы к моделированию различных сфер экономики и структуру типичных моделей и их экономическое обоснование, знать ключевые критерии качества эконометрических моделей, основные этапы создания эконометрической модели.

**уметь** корректировать существующие методы и модели в случаях, когда не выполняются их предпосылки; модифицировать подходы к моделированию различных сфер экономики и структуру типичных моделей и их экономическое обоснование в соответствии с требованиями конкретной предметной области; анализировать качество и иметь навыки корректировки для получения удовлетворительных результатов ключевых критериев качества эконометрических моделей.

**владеть** навыками работы с основными этапами создания эконометрической модели; опытом проведения эконометрического исследования от этапа постановки задачи выдвижения гипотез до анализа результатов и выводов; информацией о принятых требованиях к оформлению результатов исследования; навыками работы со статистическими пакетами, их архитектурой и основными принципами работы, а также ограничениями.

### 3. Компетенции, формируемые дисциплиной

Дисциплина направлена на формирование универсальных компетенций:

Код и наименование компетенции	Индикаторы достижения компетенций
УК-1. Способен осуществлять критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, выработать стратегию действий	Осуществляет критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, выработать стратегию действий
УК-2. Способен управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла	Принимает участие в управлении проектом на всех этапах его жизненного цикла

Дисциплина направлена на формирование общепрофессиональных компетенций:

Код и наименование компетенции	Индикаторы достижения компетенций
ОПК-1. Способен применять знания (на продвинутом уровне) фундаментальной экономической науки при решении практических и (или) исследовательских задач	Применяет знания (на продвинутом уровне) фундаментальной экономической науки при решении практических и (или) исследовательских задач
ОПК-3. Способен обобщать и критически оценивать научные исследования в экономике	Обобщает и критически оценивает научные исследования в экономике
ОПК-5. Способен использовать современные информационные технологии и программные средства при решении профессиональных задач	Использует современные информационные технологии и программные средства при решении профессиональных задач

Дисциплина направлена на формирование профессиональных компетенций:

Код и наименование компетенции	Индикаторы достижения компетенций
ПК-1. Способен осуществлять деятельность по разработке и совершенствованию прикладных статистических методологий	Участвует в разработке и совершенствовании методологии сбора и обработки статистических данных
	Участвует в разработке и совершенствовании систем статистических показателей и методик их расчета
	Участвует в проектировании новых форм статистической отчетности, вопросников и анкет, подготовке инструкций по их заполнению
ПК-2. Способен осуществлять финансовое консультирование по широкому спектру финансовых услуг	Предоставляет потребителю финансовых услуг информацию о состоянии и перспективах рынка, тенденциях в изменении курсов ценных бумаг, иностранной валюты, условий по банковским продуктам и услугам
	Разъясняет суть финансовых продуктов, юридических и экономических характеристик финансовых продуктов и услуг
	Обеспечивает взаимодействие структурных подразделений организации при совместной

	деятельности; участвует в планировании мероприятий, направленных на повышение качества финансового сервиса организации
ПК-3. Способен определять стоимость нематериальных активов и интеллектуальной собственности	Анализирует информацию о нематериальных активах и интеллектуальной собственности и совокупность прав на них
	Устанавливает экономические и правовые параметры, влияющие на стоимость нематериальных активов и интеллектуальную собственность

#### **4. Место дисциплины в структуре образовательной программы**

Дисциплина *«Прикладная макроэконометрика»* относится к части, формируемой участниками образовательных отношений, Блока 1 учебного плана программы «Магистр экономики».

Трудоёмкость дисциплины составляет 2 зачётные единицы. Общий объём академических часов – 72 часа, в том числе:

Лекции – 28 часов.

Семинары – 14 часов.

#### **5. Содержание дисциплины**

Дизайн исследования. Поиск причинно-следственных связей. Можем ли мы доверять гипотезе об условной независимости?

Отбор по наблюдаемым параметрам. Отбор подобного по вероятности.

Инструментальные переменные.

Эконометрика панельных данных. Модель с фиксированными эффектами. Модель со случайными эффектами. Разность разностей. Кластеризация.

Дизайн регрессий с разрывом.

Квантильная регрессия.

#### **6. Форма промежуточной аттестации**

Промежуточная аттестация проходит в форме экзамена.