

## **МАКРОЭКОНОМЕТРИКА**

**Преподаватель:** к.э.н., PhD доцент Фантаццини Деан

**Место дисциплины в учебном плане:** дисциплина по выбору

**Цель освоения дисциплины:** Этот курс знакомит аспирантов с набором моделей эконометрики, используемых в макроэкономическом моделировании временных рядов, финансовой экономике и денежно-кредитной экономике. Он начинается с краткого обзора теории больших выборок, а затем переходит к одноуровневому и многоуровневому обобщенному методу моментов (GMM). Вторая часть курса посвящена моделям векторной коррекции ошибок (VEC) и нелинейным моделям VEC, а третья часть – тестам на единичный корень со структурными разрывами, панельными корневыми тестами и панельными коинтеграционными тестами. В курсе подчеркивается прикладной аспект макроэкономического моделирования. По результатам обучения аспирант должен знать, как использовать модели GMM, многомерные модели VEC, нелинейные модели VEC, тесты на единичный корень и модели коинтеграции для панельных данных, для макроэкономических приложений.

**Краткое содержание:** Обзор теории больших чисел. Обобщенный метод моментов (GMM) для случаев одного и нескольких уравнений. Векторная модель коррекции ошибок (VEC). Введение в нелинейные модели и нелинейные модели коррекции ошибок. Тесты на единичный корень и модели коинтеграции для панельных данных, для макроэкономических приложений.

**Общая трудоемкость дисциплины:** составляет 2 зачетные единицы, 72 часов.

**Язык преподавания:** русский

**Итоговый контроль по дисциплине:** зачет