

Иркутский государственный университет,  
Институт математики, экономики и информатики  
(бул. Гагарина, 20, ауд.322 / комп. класс 123-А)

**10-20 мая**

**15:30–18:40**

**цикл лекций**

# **ПРИКЛАДНАЯ ЭКОНОМЕТРИКА ВРЕМЕННЫХ РЯДОВ** (с использованием пакета Stata)

***Дмитрий ВИХРОВ***  
(SERGE-EI, Прага)

**приглашаются преподаватели,  
научные сотрудники, аспиранты, студенты!**

*В течение первой недели будут рассмотрены общие методы подготовки и анализа данных, тестирование гипотез, построение доверительных интервалов, метод наименьших квадратов и максимального правдоподобия. Также будут показаны существующие способы решения проблем эндогенности и автокорреляции.*

*На второй неделе слушатели познакомятся с моделями ARIMA и GARCH, научатся выбирать оптимальное количество лагов, делать прогноз и анализировать стабильность выбранной модели. На каждой лекции будут предложены практические примеры из области финансов, макроэкономики и рынка труда.*

*Все технические расчеты будут проводиться в программном пакете STATA. Значительное внимание будет уделяться кодированию - написанию циклов, работе с макросами и созданию программ.*

**По итогам курса сдавшим экзамен выдается сертификат!  
ВХОД СВОБОДНЫЙ!!!**

**Подробности:** 8-914-88-21-888 (Александр Филатов)  
alexander.filatov@gmail.com; skype: alexander.filatov\_

<http://sibscience.org>, <http://matec.isu.ru>, <http://vk.com/baikalreadings>