

Документ подписан простой электронной подписью  
Информация о владельце:  
ФИО: Ястребов Олег Александрович  
Должность: Ректор  
Дата подписания: 18.05.2023 10:26:35  
Уникальный программный ключ:  
ca953a0120d8910839959b79078a189850ae18a

**Федеральное государственное автономное образовательное учреждение  
высшего образования «Российский университет дружбы народов имени Патриса  
Лумумбы»**

---

**Институт мировой экономики и бизнеса  
экономического факультета**

---

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ**

**ЭКОНОМЕТРИКА (ПРОДВИНУТЫЙ УРОВЕНЬ)**

---

(наименование дисциплины/модуля)

**Рекомендована МССН для направления подготовки/специальности:**

**38.04.01 Экономика**

---

(код и наименование направления подготовки/специальности)

**Освоение дисциплины ведется в рамках реализации основной профессиональной образовательной программы высшего образования (ОП ВО):**

**Международные финансы и бизнес**

---

(наименование (профиль/специализация) ОП ВО)

2023 г.

## 1. ЦЕЛЬ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Целью освоения дисциплины «Эконометрика (продвинутый уровень)» является получение знаний и развитие навыков осмысленного применения методов эконометрического анализа для решения задач профессиональной деятельности, а также ознакомление студентов с широким кругом тем в современной эконометрике.

## 2. ТРЕБОВАНИЯ К РЕЗУЛЬТАТАМ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Освоение дисциплины «Эконометрика (продвинутый уровень)» направлено на формирование у обучающихся следующих компетенций (части компетенций):

Таблица 2.1. Перечень компетенций, формируемых у обучающихся при освоении дисциплины (результаты освоения дисциплины)

| Шифр  | Компетенция  | Индикаторы достижения компетенции<br>(в рамках данной дисциплины)  |
|-------|--|--|
| УК-3  | Способность организовывать и руководить работой команды, вырабатывая командную стратегию для достижения поставленной цели      | УК-3.1 Определяет свою роль в команде, исходя из стратегии сотрудничества для достижения поставленной цели;<br>УК-3.2 Формулирует и учитывает в своей деятельности особенности поведения групп людей, выделенных в зависимости от поставленной цели;<br>УК-3.3 Анализирует возможные последствия личных действий и планирует свои действия для достижения заданного результата;<br>УК-3.4 Осуществляет обмен информацией, знаниями и опытом с членами команды;<br>УК-3.5 Аргументирует свою точку зрения относительно использования идей других членов команды для достижения поставленной цели;<br>УК-3.6 Участвует в командной работе по выполнению поручений. |
| ОПК-2 | Способен применять продвинутое инструментальные методы экономического анализа в прикладных и/или фундаментальных исследованиях | ОПК-2.1 Обладает знаниями о продвинутых инструментальных методах экономического анализа.<br>ОПК-2.2 Умеет применять знания о продвинутых инструментальных методах экономического и финансового анализа при проведении прикладных и/или фундаментальных исследований.   |
| ОПК-5 | Способность использовать современные информационные технологии и программные средства при решении профессиональных задач       | ОПК-5.1 Знает современные информационные технологии и программные средства, применяемые при решении профессиональных задач.<br>ОПК-5.2 Умеет среди современных информационных технологий и программных средств выбирать наиболее эффективные для решения профессиональных задач.<br>ОПК-5.3 Владеет в полной мере навыками решения стандартных задач профессиональной деятельности с применением информационных технологий и программных средств.  |

### 3. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОП ВО

Дисциплина Б1.О.01.03 «Эконометрика (продвинутый курс)» относится к обязательной части блока Б1 ОП ВО (базовая компонента).

В рамках ОП ВО обучающиеся также осваивают другие дисциплины и/или практики, способствующие достижению запланированных результатов освоения дисциплины «Эконометрика (продвинутый курс)».

Таблица 3.1. Перечень компонентов ОП ВО, способствующих достижению запланированных результатов освоения дисциплины

| Шифр  | Наименование компетенции  | Предшествующие дисциплины/модули, практики* | Последующие дисциплины/модули, практики*  |
|-------|---|---|---|
| УК-3  | Способность организовывать и руководить работой команды, вырабатывая командную стратегию для достижения поставленной цели         | -   | Soft Skills<br>Комплексная безопасность государственных корпораций<br>Подготовка к сдаче и сдача государственного экзамена<br>Подготовка к процедуре защиты и защита выпускной квалификационной работы  |
| ОПК-2 | Способность применять продвинутые инструментальные методы экономического анализа в прикладных и/или фундаментальных исследованиях | Макроэкономика (продвинутый уровень)        | Инновационное развитие как элемент комплексной безопасности предприятия<br>Экономическая и финансовая безопасность<br>Комплексная безопасность международного бизнеса<br>Безопасность личных финансов<br>Комплексная безопасность государственных корпораций<br>Научно-исследовательская работа<br>Подготовка к сдаче и сдача государственного экзамена<br>Подготовка к процедуре защиты и защита выпускной квалификационной работы |
| ОПК-5 | Способность использовать современные информационные технологии и программные средства при решении профессиональных задач          | -   | Agile<br>ESG<br>Комплексная безопасность государственных корпораций<br>Подготовка к сдаче и сдача государственного экзамена   |

| Шифр | Наименование компетенции | Предшествующие дисциплины/модули, практики* | Последующие дисциплины/модули, практики*                                 |
|------|--------------------------|---|--|
|      |                          |   | Подготовка к процедуре защиты и защита выпускной квалификационной работы |

#### 4. ОБЪЕМ ДИСЦИПЛИНЫ И ВИДЫ УЧЕБНОЙ РАБОТЫ

Общая трудоемкость дисциплины «Эконометрика (продвинутый уровень)» составляет 3 зачетные единицы.

Таблица 4.1. Виды учебной работы по периодам освоения ОП ВО для **ОЧНОЙ** формы обучения

| Вид учебной работы                               | ВСЕГО,<br>ак.ч. | Семестр(-ы) |           |            |   |
|--|-----------------|-------------|-----------|------------|---|
|  |                 | 1           | 2         | 3          | 4 |
| <i>Контактная работа, ак.ч.</i>                  | <i>51</i>       |             | <i>51</i> |            |   |
| в том числе:                                     |                 |             |           |            |   |
| Лекции (ЛК)                                      | 17              |             | 17        |            |   |
| Лабораторные работы (ЛР)                         | 34              |             | 34        |            |   |
| Практические/семинарские занятия (СЗ)            | -               |             | -         |            |   |
| <i>Самостоятельная работа обучающихся, ак.ч.</i> | <i>30</i>       |             | <i>30</i> |            |   |
| <i>Контроль (экзамен/зачет с оценкой), ак.ч.</i> | <i>27</i>       |             | <i>27</i> |            |   |
| <b>Общая трудоемкость дисциплины</b>             | ак.ч.           | <b>108</b>  |           | <b>108</b> |   |
|  | зач.ед.         | <b>3</b>    |           | <b>3</b>   |   |

#### 5. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Таблица 5.1. Содержание дисциплины (модуля) по видам учебной работы

| Наименование раздела дисциплины   | Содержание раздела (темы)   | Вид учебной работы* |
|---|---|---------------------|
| <b>Раздел 1.</b> Модель множественной линейной регрессии                    | Парная модель линейной регрессии. Многофакторная модель линейной регрессии. Асимптотические свойства МНК-оценок. Отбор множества объясняющих переменных. Сравнение вложенных и не вложенных моделей. Тестирование функциональной формы. Фиктивные переменные в моделях регрессии. | ЛК, ЛР              |
| <b>Раздел 2.</b> Методы оценки при нарушении условий классической регрессии | Методы оценивания при различных предположениях: ОМНК, ДОМНК, МИП, ОМИП, ДМНК, ММП   | ЛК, ЛР              |
| <b>Раздел 3.</b> Одномерные модели временных рядов                          | ARMA-модели. Единичные корни. Тесты на единичный корень. Условная гетероскедастичность. ARCH и GARCH модели.  | ЛК, ЛР              |
| <b>Раздел 4.</b> Многомерные модели временных рядов                         | Динамические модели со стационарными переменными. Модели с нестационарными переменными. Коинтеграция. Тестирование на коинтеграцию.   | ЛК, ЛР              |

## 6. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Таблица 6.1. Материально-техническое обеспечение дисциплины

| Тип аудитории                          | Оснащение аудитории  | Специализированное учебное/лабораторное оборудование, ПО и материалы для освоения дисциплины (при необходимости)  |
|--|--|---|
| Лекционная                             | Аудитория для проведения занятий лекционного типа, оснащенная комплектом специализированной мебели; доской (экраном) и техническими средствами мультимедиа презентаций   | Комплект специализированной мебели, экран настенный, проектор, ноутбук с программным обеспечением (ОС Microsoft, пакет офисных приложений, в т.ч. MS Office/ Office 365, Teams) |
| Семинарская                            | Аудитория для проведения занятий семинарского (практического) типа, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, оснащенная комплектом специализированной мебели и техническими средствами мультимедиа презентаций | Комплект специализированной мебели, экран настенный, проектор, ноутбук с программным обеспечением (ОС Microsoft, пакет офисных приложений, в т.ч. MS Office/ Office 365, Teams) |
| Для самостоятельной работы обучающихся | Аудитория для самостоятельной работы обучающихся (может использоваться для проведения семинарских занятий и консультаций), оснащенная комплектом специализированной мебели и компьютерами с доступом в ЭИОС (аудитория 426)                                  | Комплект специализированной мебели, экран настенный, проектор, ноутбук с программным обеспечением (ОС Microsoft, пакет офисных приложений, в т.ч. MS Office/ Office 365, Teams) |

## 7. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

### *Основная литература:*

1. Елисеева И.И. и др. Эконометрика: учебник для вузов/ Под ред. И.И.Елисеевой.- М.: Юрайт, 2022 (электронная книга, доступ по подписке РУДН <https://urait.ru/viewer/ekonometrika-488603>).
2. Эконометрика в задачах и решениях [Текст/электронный ресурс] : Учебное пособие для магистров / С.А. Балашова, И.В. Лазанюк. – 2-е изд. -Электронные текстовые данные. - М. : Изд-во РУДН, 2017. - 188 с. : ил. - ISBN 978-5-209-05771-0 : 105.19.

### *Дополнительная литература:*

1. Подкорытова, О. А. Анализ временных рядов : учеб. пособие для бакалавриата и магистратуры / О. А. Подкорытова, М. В. Соколов. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва :

Издательство Юрайт, 2019. — 267 с. — (Серия : Бакалавр и магистр. Модуль). — ISBN 978-5-534-02556-9. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://biblio-online.ru/bcode/433180>

2. Теория статистики с элементами эконометрики в 2 ч. Часть 2 : учебник для вузов / В. В. Ковалев [и др.] ; отв. ред. В. В. Ковалев. — М. : Издательство Юрайт, 2022. — 333 с.— ISBN 978-5-534-04021-0 (ч. 2) (электронная книга, доступ по подписке РУДН <https://urait.ru/viewer/teoriya-statistiki-s-elementami-ekonometriki-v-2-ch-chast-2-490798>).

### ***Ресурсы информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»:***

1. ЭБС РУДН и сторонние ЭБС, к которым студенты университета имеют доступ на основании заключенных договоров:

- Электронно-библиотечная система РУДН – ЭБС РУДН <http://lib.rudn.ru/MegaPro/Web>
- ЭБС «Университетская библиотека онлайн» <http://www.biblioclub.ru>
- ЭБС Юрайт <http://www.biblio-online.ru>
- ЭБС «Консультант студента» [www.studentlibrary.ru](http://www.studentlibrary.ru)
- ЭБС «Лань» <http://e.lanbook.com/>
- ЭБС «Троицкий мост»

2. Базы данных и поисковые системы:

- электронный фонд правовой и нормативно-технической документации <http://docs.cntd.ru/>

- поисковая система Яндекс <https://www.yandex.ru/>

- поисковая система Google <https://www.google.ru/>

- реферативная база данных SCOPUS <http://www.elsevierscience.ru/products/scopus/>

- <http://www.gks.ru/> – портал Федеральной службы государственной статистики РФ

- <http://www.cbr.ru/> – портал Центрального банка РФ

- <http://data.worldbank.org/> - база данных Мирового банка

- <https://ec.europa.eu/eurostat/data/database> - база данных стран Евросоюза

- <https://www.imf.org/external/datamapper/datasets> - базы данных Международного валютного фонда

*Учебно-методические материалы для самостоятельной работы обучающихся при освоении дисциплины/модуля\*:*

1. Курс лекций по дисциплине «Эконометрика (продвинутый курс)».

2. Лабораторный практикум по дисциплине «Эконометрика (продвинутый курс)»

\* - все учебно-методические материалы для самостоятельной работы обучающихся размещаются в соответствии с действующим порядком на странице дисциплины **в ТУИС!**

<https://esystem.rudn.ru/course/view.php?id=1787>

## **8. ОЦЕНОЧНЫЕ МАТЕРИАЛЫ И БАЛЛЬНО-РЕЙТИНГОВАЯ СИСТЕМА ОЦЕНИВАНИЯ УРОВНЯ СФОРМИРОВАННОСТИ КОМПЕТЕНЦИЙ ПО ДИСЦИПЛИНЕ**

Оценочные материалы и балльно-рейтинговая система\* оценивания уровня сформированности компетенций (части компетенций) по итогам освоения дисциплины «Эконометрика (продвинутый курс)» представлены в Приложении к настоящей Рабочей программе дисциплины.

\* - ОМ и БРС формируются на основании требований соответствующего локального нормативного акта РУДН.

**РАЗРАБОТЧИКИ:**

**К.ф.н., Доцент**



**Балашова С.А.**

---

Должность, БУП

---

Подпись

---

Фамилия И.О.

**РУКОВОДИТЕЛЬ ОП ВО:**

**К.э.н., доцент, Руководитель программы  
«Мировая экономика»**



**Айдрус И.А.З.**

---

Должность, БУП

---

Подпись

---

Фамилия И.О.