

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

Высшая школа промышленной политики и предпринимательства

(наименование основного учебного подразделения (ОУП)-разработчика ОП ВО)

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):

«Комплаенс-контроль в деятельности организаций»

(наименование (профиль/специализация) ОП ВО)

2022 г.

1. ЦЕЛЬ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ:

Основная цель дисциплины «Эконометрика (продвинутый курс)» – подготовка студентов к прикладным исследованиям в области построения эконометрических моделей, применяемых в наукоемких отраслях, их идентификации и прогнозирования.

Основными задачами курса являются:

- усвоение студентами знаний об эконометрических методах;
- развитие навыков использования этих методов при исследовании экономических объектов и процессов;
- развитие умений построения эконометрических моделей и проверки их идентификации;
- выработка умений оценки параметров моделей, прогнозирования и оценки точности прогнозов;
- развитие навыков исследовательской деятельности (систематизация, исследование статистических данных и выводы).

2. ТРЕБОВАНИЯ К РЕЗУЛЬТАТАМ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ:

Освоение дисциплины «Эконометрика (продвинутый курс)» 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 (в рамках данной дисциплины)
УК-3	Способен 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; УК-3.2. Формулирует и учитывает в своей деятельности особенности поведения групп людей, выделенных в зависимости от поставленной цели; УК-3.3. Анализирует возможные последствия личных действий и планирует свои действия для достижения заданного результата; УК-3.4. Осуществляет обмен информацией, знаниями и опытом с членами команды; УК-3.5. Аргументирует свою точку зрения относительно использования идей других членов команды для достижения поставленной цели; УК-3.6. Участвует в командной работе по выполнению поручений.
ОПК-2	Способен применять продвинутые инструментальные методы экономического анализа в прикладных	ОПК-2.1. Обладает знаниями о продвинутых инструментальных методах экономического анализа; ОПК-2.2. Умеет применять знания о продвинутых инструментальных методах экономического и

Шифр	Компетенция	Индикаторы достижения компетенции (в рамках данной дисциплины)
	и/или фундаментальных исследованиях	финансового анализа при проведении прикладных и/или фундаментальных исследований;
ОПК-5	Способен 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 ОПК-5.2 Умеет среди современных информационных технологий и программных средств выбирать наиболее эффективные для решения профессиональных задач. 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 «Эконометрика (продвинутый курс)» относится к обязательной части/части, формируемой участниками образовательных отношений блока Б1 ОП ВО.

В таблице № 1 приведены предшествующие и последующие дисциплины, направленные на формирование компетенций дисциплины в соответствии с матрицей компетенций ОП ВО.

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	Способен организовывать и руководить работой команды, выработывая командную стратегию для достижения поставленной цели		Корпоративные финансы и финансовый анализ Финансовое планирование и бюджетирование Стратегический менеджмент Управление инвестициями Нормирование и оплата труда Научеёмкие производства и кластеры

Шифр	Наименование компетенции	Предшествующие дисциплины/модули, практики*	Последующие дисциплины/модули, практики*
			Маркетинговая аналитика больших данных Преддипломная практика НИРМ
ОПК-2	Способен применять продвинутое инструментальные методы экономического анализа в прикладных и/или фундаментальных исследованиях		Макроэкономика (продвинутый курс) Анализ и регулирование отраслевых рынков Преддипломная практика НИРМ
ОПК-5	Способен использовать современные информационные технологии и программные средства при решении профессиональных задач		Антикризисное управление и реинжиниринг организации Управление проектами Корпоративный риск-менеджмент Информационная безопасность Стратегический менеджмент Управление инвестициями Оценка бизнеса и управление стоимостью компании Особенности ценообразования в наукоемких отраслях Преддипломная практика НИРМ

4. ОБЪЕМ ДИСЦИПЛИНЫ И ВИДЫ УЧЕБНОЙ РАБОТЫ

Общая трудоемкость дисциплины «Эконометрика (продвинутый курс)» составляет ___3___ зачетных единиц.

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

Вид учебной работы	Всего часов	Семестр (модуль)
		1 (2)
Контактная работа, ак.ч.	27	27

В том числе:	-	-
Лекции	9	9
Практические занятия (ПЗ)	9	9
Семинары (С)	9	9
Лабораторные работы (ЛР)	-	-
Самостоятельная работа обучающихся, ак.ч.	63	63
Контроль (экзамен/зачет с оценкой), ак.ч	18	18
Общая трудоемкость	час	108
	зач. ед.	3

5. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

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

Наименование раздела дисциплины	Содержание раздела (темы)	Вид учебной работы*
Раздел 1. Основы эконометрики	Основы эконометрики	ЛК, СЗ
Раздел 2. Числовые характеристики статистических данных	Числовые характеристики статистических данных	ЛК, СЗ
Раздел 3. Модель парной линейной регрессии	Модель парной линейной регрессии	ЛК, СЗ
Раздел 4. Множественный регрессионный анализ	Множественный регрессионный анализ	ЛК, СЗ
Раздел 5. Проверка качества уравнения регрессии и её параметров	Проверка качества уравнения регрессии и её параметров	ЛК, СЗ
Раздел 6. Нелинейные модели регрессии и их линеаризация	Нелинейные модели регрессии и их линеаризация	ЛК, СЗ
Раздел 7. Мультиколлинеарность. Автокорреляция. Гетероскедастичность	Мультиколлинеарность. Автокорреляция. Гетероскедастичность.	ЛК, СЗ
Раздел 8. Моделирование динамических процессов	Моделирование динамических процессов	ЛК, СЗ
Раздел 9. Адаптивные методы прогнозирования	Адаптивные методы прогнозирования	ЛК, СЗ

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.	21 рабочее место: сист.блок P4 C2D/3160 MHz MB/ 320 GB/DVD±RW/ LCD monitor 19"+ 1 проектор
Лаборатория	Аудитория для проведения лабораторных работ, индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, оснащенная комплектом специализированной мебели и оборудованием.	21 рабочее место: сист.блок Celeron /2600 MHz/1280 MB/ 40 GB/DVD ROM/ LCD monitor 17"+ 1 проектор + Точка доступа WiFi
Семинарская	Аудитория для проведения занятий семинарского типа, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, оснащенная комплектом специализированной мебели и техническими средствами мультимедиа презентаций.	21 рабочее место: сист.блок P4 C2D/3160 MHz MB/ 320 GB/DVD±RW/ LCD monitor 19"+ 1 проектор
Компьютерный класс	Компьютерный класс для проведения занятий, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, оснащенная персональными компьютерами (в количестве ___ шт.), доской (экраном) и техническими средствами мультимедиа презентаций.	21 рабочее место: сист.блок Celeron /2600 MHz/1280 MB/ 40 GB/DVD ROM/ LCD monitor 17"+ 1 проектор + Точка доступа WiFi
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.	420 ауд.

7. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Основная литература:

1. Айвазян С. А. Эконометрика – 2: продвинутый курс с приложениями в финансах: Учеб. / С.А. Айвазян, Д. Фантаццини; Московская школа экономики МГУ им. М.В. Ломоносова (МШЭ). – М.: Магистр: НИЦ ИНФРА-М, 2014. – 944 с.
2. Балашова С.А. Лазанюк И.В. Эконометрика в задачах и решениях: учебное пособие для магистров. 2-е изд., испр. м доп. – М.: Изд-во РУДН, 2014. – 188 с.
3. Галочкин В.Т. Эконометрика: учебник и практикум для вузов. – М.: Юрайт, 2021. – 288 с. – (Высшее образование).
4. Матюшок В.М. Основы эконометрического моделирования с использованием Eviews: Учебное пособие / В.М. Матюшок, С.А. Балашова, И.В. Лазанюк. – 3-е изд., перераб. и доп. – М.: Изд-во РУДН, 2015.
5. Суслов В. И., Ибрагимов Н. М., Тальшева Л. П., Цыплаков А. А. Эконометрия переходного периода / под ред.. Г.М. Мкртчяна– Новосибирск: СО РАН, 2005. – 744 с.
6. Эконометрика: учебник для бакалавриата и магистратуры / И.И. Елисеева [и др.]; под ред. И.И. Елисеевой. – М.: Издательство Юрайт, 2018. – 449 с. – Серия: бакалавр и магистр. Академический курс.

Дополнительная литература

1. Бородич С.А. Эконометрика: учеб. пособие – 3-е изд., стер. – Мн.: Новое знание, 2006. – 408 с. – (Экономическое образование).
2. Бабешко Л. Основы эконометрического моделирования: Учебное пособие. – М.: КомКнига, 2007.
3. Берндт, Э. Р. Практика эконометрики: классика и современность: учебник. – М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2005. – 863 с.
4. Вербик М. Путеводитель по современной эконометрике. – М.: Научная книга, 2008.
5. Джонстон Дж. Эконометрические методы. – М.: Статистика, 1980. – 350с.
6. Доугерти К. Введение в эконометрику: Учебник для вузов: Пер. с англ.- 2-е изд.- М.: ИНФРА-М, 2009.
7. Замков О.О. Эконометрические методы в макроэкономическом анализе: курс лекций. – М.: ГУ ВШЭ, 2001. – 122 с.
8. Колеников С.О. Прикладной эконометрический анализ в статистическом пакете Stata6 в формате PDF. – Режим доступа : <http://www.komkon.org/~tacik/Stata6Ec.pdf>.
9. Лекции по эконометрике: учебное пособие для студентов высших учебных заведений, обучающихся по специальности «Прикладная информатика (в экономике)» / Н.И. Шанченко. – Ульяновск: УлГТУ, 2008. – 139 с.
10. Магнус Я.Р. Эконометрика. Начальный курс / Я.Р. Магнус, П.К. Катышев, А.А. Пересецкий. – М.: Дело, 1997. – 247 с.
11. Математическое Бюро. Учебники по эконометрике и статистике. – Режим доступа: http://www.matburo.ru/st_subject.php?p=ec.
12. Мхитарян В.С. Эконометрика: учебно-практическое пособие В.С. Мхитарян, М.Ю. Архипова, В.П. Сиротин. – М.: ЕАОИ, 2012. – 224 с.
13. Практикум по эконометрике: Учеб. пособие / И.И. Елисеева, С.В. Курьшева, Н.М. Гордеенко и др.; Под ред. И.И. Елисеевой. – М.: Финансы и статистика, 2010. – 192 с.
14. Тихомиров Н.П. Эконометрика: учебник для вузов / Н.П. Тихомиров, Е.Ю. Дорохина; Рос. экон. акад. им. Г.В. Плеханова. – М.: Экзамен, 2003. – 510 с.
15. Эконометрика: учебник для студентов вузов / Н.Ш. Кремер, Б.А. Путко; под ред. Н.Ш. Кремера. – 3-е изд., перераб. и доп. – М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2010. – 328 с. – (Серия «Золотой фонд российских учебников»).
16. Green W.H. Econometric Analysis, 2008.

Журналы:

1. Квантиль.
2. Прикладная эконометрика.
3. Экономика и математические методы.
4. Экономическая наука современной России.

Ресурсы информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»:

а) программное обеспечение: Windows, стандартный пакет Office, Internet-браузер и ТУИС РУДН; Microsoft Excel (минимальные требования) либо один из пакетов обработки статистических данных: Statistica, SPSS, Eview, Stata, Stadia и др.

б) базы данных, информационно-справочные и поисковые системы:

1. База данных Мирового банка [Электронный ресурс] – Режим доступа: <http://data.worldbank.org/>.
2. Библиотека РУДН [Электронный ресурс] – Режим доступа: <http://lib.rudn.ru>.
3. Бюро статистики труда США [Электронный ресурс] – Режим доступа: <http://www.bls.gov/>.
4. Научная электронная библиотека [Электронный ресурс] – Режим доступа: www.elibrary.ru.
5. Российская государственная библиотека [Электронный ресурс] – Режим доступа: <http://www.rsl.ru/>.
6. Статистика стран ОЭСР [Электронный ресурс] – Режим доступа: <http://www.oecd.org/statistics/>.
7. Универсальная база данных, коллекции журналов, статистических сборников [Электронный ресурс] – Режим доступа: <http://www.eastview.com>.
8. Учебный портал экономического факультета РУДН [Электронный ресурс] – Режим доступа: <http://economist.rudn.ru/run/course/?cid=337>.
9. Федеральная служба государственной статистики [Электронный ресурс] – Режим доступа: <http://www.gks.ru>.
10. Центральный банк РФ [Электронный ресурс] – Режим доступа: www.cbr.ru.

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

1. Курс лекций по дисциплине «Эконометрика (продвинутый курс)».
2. Учебно-методические материалы для самостоятельной работы обучающихся размещаются в соответствии с действующим порядком на странице дисциплины **в ТУИС**

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

Дисциплина носит прикладной характер и направлена на освоение (закрепление, совершенствование) практических навыков обработки экономической информации построения, проверки и интерпретации регрессионных моделей, а также из использования в практической деятельности для выявления связей между экономическими явлениями, а также – для прогнозирования экономических процессов.

В результате самостоятельной работы студент должен овладеть следующими компетенциями:

- способностью организовать и руководить работой команды, вырабатывая командную стратегию для достижения поставленной цели (УК-3);
- способностью применять продвинутые инструментальные методы экономического анализа в прикладных и/или фундаментальных исследованиях (ОПК-2);
- способностью использовать современные информационные технологии и программные средства при решении профессиональных задач (ОПК-5);
- способностью руководить проектами реинжиниринга бизнес-процессов промышленной организации с использованием современных информационных технологий (ПК-16).

Аттестация базируется в основном на оценке самостоятельной работы студента по выполнению практических заданий и домашних работ. Кроме того, предусмотрена возможность подготовки рефератов, презентаций, докладов как по теории эконометрики, так и по результатам самостоятельного исследования для выступления на семинаре, подготовки тезисов либо научной статьи для печати в научном периодическом издании.

Аттестация студентов по курсу «Эконометрика (продвинутый курс)» проводится по балльно-рейтинговой системе:

Максимальное количество баллов – 100.

Количество кредитов – 4.

Максимальное количество баллов за выполнение каждого вида работ:

1. опрос – 20 баллов
2. выполнение ДЗ – 20 баллов
3. работа на занятии – 20 баллов
4. доклад – 10 баллов
5. промежуточная КР – 10 баллов
6. итоговая КР – 20 баллов;

Оценка **неудовлетворительно** выставляется в форме F(2); FX(2+).

Оценка F(2) выставляется при условии, если студент набрал менее 30 баллов, оценка FX(2+) – 31-50 баллов. Оценка FX(2+) даёт возможность для пересдачи экзамена или зачёта.

Оценка **удовлетворительно** выставляется в форме E(3); D(3+). Оценка E(3) выставляется при условии, если студент набрал от 51 до 60 баллов. Оценка D(3+) – при условии наличия 61-68 баллов.

Оценка **хорошо** выставляется в форме C(4) при условии, если студент набрал 69-85 баллов.

Оценка **отлично** выставляется в форме B(5); A(5+). Оценка B(5) выставляется, если студент набрал 86-94 балла и свидетельствует о выполнении всех требуемых условий прохождения курса. Оценка A(5+) – 95-100 баллов выставляется не только при условии выполнения всех требований, но и с обязательным проявлением творческого отношения к предмету, умения находить оригинальные, не содержащиеся в учебниках ответы, умения

работать с источниками, которые содержатся дополнительной литературе к курсу, умения соединять знания, полученные в данном курсе со знаниями других дисциплин.

Баллы БРС	Традиционные оценки РФ	Оценки ECTS
95 – 100	Отлично – 5	A (5+)
86 – 94		B (5)
69 – 85	Хорошо – 4	C (4)
61 – 68	Удовлетворительно – 3	D (3+)
51 – 60		E (3)
31 – 50	Неудовлетворительно – 2	FX (2+)
0 – 30		F (2)
51 - 100	Зачет	Passed

Материалы для оценки уровня освоения учебного материала дисциплины «Эконометрика (продвинутый уровень)» (оценочные материалы), включающие в себя перечень компетенций с указанием этапов их формирования, описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания, типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций в процессе освоения образовательной программы, методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций, разработаны в полном объеме и доступны для обучающихся на странице дисциплины в ТУИС РУДН.

РАЗРАБОТЧИКИ:

Заведующий кафедрой
«Комплаенс и контроллинг»



Рагулина Ю.В.

Должность, БУП

Подпись

Фамилия И.О.

РУКОВОДИТЕЛЬ БУП:

Заведующий кафедрой
«Комплаенс и контроллинг»



Рагулина Ю.В.

Наименование БУП

Подпись

Фамилия И.О.

РУКОВОДИТЕЛЬ ОП ВО:

Заведующий кафедрой
«Комплаенс и контроллинг»



Рагулина Ю.В.

Должность, БУП

Подпись

Фамилия И.О.