

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Ястребов Олег Александрович
Должность: Ректор
Дата подписания: 06.05.2026 12:13:33
Уникальный программный ключ:
ca953a0120d891083f939673078ef1a989dae18a

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

Экономический факультет

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

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

ЭКОНОМЕТРИКА (ПРОДВИНУТЫЙ КУРС)

(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):

КОРПОРАТИВНАЯ ЭКОНОМИКА И УПРАВЛЕНИЕ БИЗНЕСОМ

(наименование (профиль/специализация) ОП ВО)

2026 г.

1. ЦЕЛЬ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Дисциплина «Эконометрика (продвинутый курс)» входит в программу магистратуры «Корпоративная экономика и управление бизнесом» по направлению 38.04.01 «Экономика» и изучается во 2 семестре 1 курса. Дисциплину реализует Кафедра экономико-математического моделирования. Дисциплина состоит из 4 разделов и 13 тем и направлена на изучение тем, расширяющих базовые знания по курсу «Эконометрика»

Целью освоения дисциплины 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 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-1	Способен осуществлять критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, вырабатывать стратегию действий	УК-1.1 Анализирует задачу, выделяя ее базовые составляющие;; УК-1.2 Определяет и ранжирует информацию, требуемую для решения поставленной задачи;; УК-1.3 Осуществляет поиск информации для решения поставленной задачи по различным типам запросов;; УК-1.4 Предлагает варианты решения задачи, анализирует возможные последствия их использования;; УК-1.5 Анализирует пути решения проблем мировоззренческого, нравственного и личностного характера на основе использования основных философских идей и категорий в их историческом развитии и социально-культурном контексте.;
ОПК-1	Способен применять знания (на продвинутом уровне) фундаментальной экономической науки при решении практических и (или) исследовательских задач;	ОПК-1.1 Обладает фундаментальными знаниями в области экономической науки.;; ОПК-1.2 Умеет использовать фундаментальные знания для решения прикладных и/или исследовательских задач.;; ОПК-1.3 Владеет навыками выбора методов решения практических и исследовательских задач на основе фундаментальных экономических знаний.;
ОПК-3	Способен обобщать и критически оценивать научные исследования в экономике;	ОПК-3.1 Разрабатывает программу прикладного и/или фундаментального исследования в области экономики на основе оценки и обобщения результатов научных исследований, проведенных другими авторами.;; ОПК-3.2 Готовит аналитическую записку по результатам прикладного и/или фундаментального исследования в области экономики.;; ОПК-3.3 Обобщает выводы, готовит заключение и формулирует рекомендации по результатам прикладного и/или фундаментального исследования в области экономики.;
ПК-1	Способен осуществлять анализ и прогноз основных социально-экономических показателей деятельности предприятия, отрасли, региона и экономики в целом	ПК-1.1 Способен подготавливать аналитические материалы для оценки мероприятий в области экономической политики и принятия стратегических решений на микро- и макроуровне;; ПК-1.2 Способен анализировать и использовать различные источники информации для проведения экономических расчетов;; ПК-1.3 Способен составлять прогноз основных социально-

Шифр	Компетенция	Индикаторы достижения компетенции (в рамках данной дисциплины)
		экономических показателей деятельности предприятия, отрасли, региона и экономики в целом;;

3. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОП ВО

Дисциплина «Эконометрика (продвинутый курс)» относится к обязательной части блока 1 «Дисциплины (модули)» образовательной программы высшего образования.

В рамках образовательной программы высшего образования 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-1	Способен осуществлять критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, выработать стратегию действий	Научно-исследовательская работа; Адаптивный курс по основам экономики;	Оценка бизнеса и управление его стоимостью; Бизнес-аналитика; Преддипломная практика; Научно-исследовательская работа;
ОПК-1	Способен применять знания (на продвинутом уровне) фундаментальной экономической науки при решении практических и (или) исследовательских задач;	Правовая среда бизнеса; Научно-исследовательская работа;	Преддипломная практика; Научно-исследовательская работа;
ОПК-3	Способен обобщать и критически оценивать научные исследования в экономике;	Научно-исследовательская работа; Микроэкономика (продвинутый курс); Экономика современного предприятия;	Преддипломная практика; Научно-исследовательская работа;
ПК-1	Способен осуществлять анализ и прогноз основных социально-экономических показателей деятельности предприятия, отрасли, региона и экономики в целом	Научно-исследовательская работа; Микроэкономика (продвинутый курс); <i>Экономическая конфликтология**;</i> <i>Лидерство в корпоративной среде**;</i> Экономика современного предприятия;	Преддипломная практика; Научно-исследовательская работа; Оценка бизнеса и управление его стоимостью; Инвестиционный анализ; <i>Международный бизнес-консалтинг**;</i> <i>Внешнеторговая политика и основы таможенно-тарифного регулирования**;</i> <i>Бизнес-проектирование стартапа**;</i> <i>Экономика и организация бизнес-процессов**;</i>

* - заполняется в соответствии с матрицей компетенций и СУП ОП ВО

** - элективные дисциплины /практики

4. ОБЪЕМ ДИСЦИПЛИНЫ И ВИДЫ УЧЕБНОЙ РАБОТЫ

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

Таблица 4.1. Виды учебной работы по периодам освоения образовательной программы высшего образования для очной формы обучения.

Вид учебной работы	ВСЕГО, ак.ч.		Семестр(-ы)
			2
Контактная работа, ак.ч.	54		54
Лекции (ЛК)	18		18
Лабораторные работы (ЛР)	0		0
Практические/семинарские занятия (СЗ)	36		36
Самостоятельная работа обучающихся, ак.ч.	36		36
Контроль (экзамен/зачет с оценкой), ак.ч.	18		18
Общая трудоемкость дисциплины	ак.ч.	108	108
	зач.ед.	3	3

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

Таблица 4.2. Виды учебной работы по периодам освоения образовательной программы высшего образования для очно-заочной формы обучения.

Вид учебной работы	ВСЕГО, ак.ч.		Семестр(-ы)
			3
Контактная работа, ак.ч.	36		36
Лекции (ЛК)	18		18
Лабораторные работы (ЛР)	0		0
Практические/семинарские занятия (СЗ)	18		18
Самостоятельная работа обучающихся, ак.ч.	36		36
Контроль (экзамен/зачет с оценкой), ак.ч.	36		36
Общая трудоемкость дисциплины	ак.ч.	108	108
	зач.ед.	3	3

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

Таблица 4.3. Виды учебной работы по периодам освоения образовательной программы высшего образования для заочной формы обучения.

Вид учебной работы	ВСЕГО, ак.ч.		Семестр(-ы)
			3
<i>Контактная работа, ак.ч.</i>	24		24
Лекции (ЛК)	12		12
Лабораторные работы (ЛР)	0		0
Практические/семинарские занятия (СЗ)	12		12
<i>Самостоятельная работа обучающихся, ак.ч.</i>	75		75
<i>Контроль (экзамен/зачет с оценкой), ак.ч.</i>	9		9
Общая трудоемкость дисциплины	ак.ч.	108	108
	зач.ед.	3	3

5. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

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

Номер раздела	Наименование раздела дисциплины	Наименование темы		Содержание темы	Вид учебной работы*
Раздел 1	Модель множественной линейной регрессии	1.1	Модель регрессии	Постановка задачи. Парная модель линейной регрессии. Многофакторная модель линейной регрессии	ЛК, СЗ
		1.2	Предпосылки классической линейной регрессии	Метод наименьших квадратов (МНК). Предпосылки Гаусса-Маркова. Свойства оценок	ЛК, СЗ
		1.3	Спецификация модели.	Вложенные и невложенные модели. Проблема невключения переменных. Проблема включения лишних переменных. Тесты на спецификацию модели	ЛК, СЗ
		1.4	Фиктивные переменные в моделях регрессии	Фиктивные переменные сдвига и переменные наклона. Интерпретация коэффициентов. Использование перекрестных членов в моделях регрессии	ЛК, СЗ
Раздел 2	Методы оценки при нарушении условий классической регрессии	2.1	Обобщенный метод наименьших квадратов при нарушении предпосылок Гаусса-Маркова	Общая формулировка ОМНК. Доступный МНК, взвешанный МНК. Последствия применения МНК при нарушении классических предпосылок	ЛК, СЗ
		2.2	Эндогенность, инструментальные переменные	Проблема эндогенности в моделях регрессии. Метод инструментальных переменных. Двухшаговый метод наименьших квадратов	ЛК, СЗ
Раздел 3	Одномерные модели временных рядов	3.1	Предпосылки моделей с временными рядами	Особенности порождения данных и построения выборки для временного ряда. Статистические свойства временного ряда.	ЛК, СЗ
		3.2	Стационарность. Тестирование единичных корней	Понятие слабой и строгой стационарности. Оператор сдвига. Расширенный тест Дики-Фуллера. Альтернативные тесты на стационарность	ЛК, СЗ
		3.3	ARMA- и ARIMA-модели	Процедура Бокса-Дженкинса. Подбор подходящей модели. Метод максимального правдоподобия для оценки ARMA моделей.	ЛК, СЗ
		3.4	Условная гетероскедастичность. ARCH и GARCH модели	Понятие условной гетероскедастичности. Кластеризация волатильности. Модель ARCH. Модель GARCH. Тестирование и оценивание. Асимметричные модели	ЛК, СЗ
Раздел 4	Многомерные модели временных рядов	4.1	Динамические модели со стационарными переменными.	Модели с распределенными лагами. Преобразование Койка. Модели авторегрессии и распределенного лага. Многомерные динамические модели	ЛК, СЗ
		4.2	Модели с нестационарными переменными.	Ложные регрессии. Коинтеграция. Тестирование на коинтеграцию: подход Энгла-Грэнжера	ЛК, СЗ

Номер раздела	Наименование раздела дисциплины	Наименование темы		Содержание темы	Вид учебной работы*
		4.3	Модель коррекции ошибок	Алгоритм оценки ARDL модели с нестационарными переменными. Тест на коинтеграцию. Оценка долгосрочных и краткосрочных эффектов	ЛК, СЗ

* - заполняется только по **ОЧНОЙ** форме обучения: ЛК – лекции; ЛР – лабораторные работы; СЗ – практические/семинарские занятия.

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.	
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.	
Для самостоятельной работы	Аудитория для самостоятельной работы обучающихся (может использоваться для проведения семинарских занятий и консультаций), оснащенная комплектом специализированной мебели и компьютерами с доступом в ЭИОС.	

* - аудитория для самостоятельной работы обучающихся указывается **ОБЯЗАТЕЛЬНО!**

7. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Основная литература:

1. Эконометрика : учебник для вузов / под редакцией И. И. Елисеевой. — Москва : Издательство Юрайт, 2026. — 449 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-00313-0. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/582522>

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, 2020. - 188 с. : ил. - ISBN 978-5-209-05771-0 : 105.19.

Дополнительная литература:

1. Подкорытова, О. А. Анализ временных рядов : учебное пособие для вузов / О. А. Подкорытова, М. В. Соколов. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2026. — 225 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-19441-8. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/583435>

2. Теория статистики с элементами эконометрики : учебник для вузов / ответственный редактор В. В. Ковалев. — Москва : Издательство Юрайт, 2026. — 595 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-17938-5. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/600359>

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

<https://mega.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

- ЭБС «Знаниум» <https://znanium.ru/>

2. Базы данных и поисковые системы

- Sage <https://journals.sagepub.com/>

- Springer Nature Link <https://link.springer.com/>

- Wiley Journal Database <https://onlinelibrary.wiley.com/>

- Наукометрическая база данных Lens.org <https://www.lens.org>

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

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

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

РАЗРАБОТЧИК:

Доцент

Должность, БУП

Подпись

Балашова Светлана

Алексеевна

Фамилия И.О.

РУКОВОДИТЕЛЬ БУП:

Заведующий кафедрой

Должность БУП

Подпись

Балашова Светлана

Алексеевна [М]

Заведующий кафедр

Фамилия И.О.

РУКОВОДИТЕЛЬ ОП ВО:

Доцент

Должность, БУП

Подпись

Черняев Максим

Васильевич

Фамилия И.О.