

Документ подписан простой электронной подписью  
Информация о владельце:  
ФИО: Ястребов Олег Александрович  
Должность: Ректор  
Дата подписания: 21.05.2024 11:03:05  
Уникальный программный ключ:  
ca953a01204891083f939673078ef1a989dae18a

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

**Высшая школа управления**

(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):**

#### **КОМПЛАЕНС-КОНТРОЛЬ В ДЕЯТЕЛЬНОСТИ ОРГАНИЗАЦИЙ**

(наименование (профиль/специализация) ОП ВО)

**2024 г.**

## 1. ЦЕЛЬ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Дисциплина «Эконометрика (продвинутый курс)» входит в программу магистратуры «Комплаенс-контроль в деятельности организаций» по направлению 38.04.01 «Экономика» и изучается в 1 семестре 1 курса. Дисциплину реализует Кафедра комплаенса и контроллинга. Дисциплина состоит из 9 разделов и 9 тем и направлена на изучение «Эконометрика (продвинутый курс)»

Целью освоения дисциплины является подготовка студентов к прикладным исследованиям в области построения эконометрических моделей, применяемых в наукоемких отраслях, их идентификации и прогнозирования.

## 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<br>(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;;<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 | 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.;<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 «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-3  | Способен организовывать и руководить работой команды, вырабатывая командную стратегию для достижения поставленной цели         |   | <p>Научно-исследовательская работа;</p> <p>Преддипломная практика;</p> <p>Комплаенс в области регулирования рынка ценных бумаг**;</p> <p>Комплаенс в области проведения торгов и закупочной деятельности**;</p> <p>Зарубежная практика применения комплаенс-контроля в деятельности хозяйствующего субъекта**;</p> <p>Обеспечение кибербезопасности хозяйствующего субъекта**;</p> <p>Риск-менеджмент и комплаенс**;</p> <p>Оценка коррупционных рисков хозяйствующего субъекта**;</p> <p>Противодействие корпоративному мошенничеству**;</p> <p>Нормативно-правовое обеспечение комплаенс-контроля в деятельности организации**;</p> <p>Система комплаенс-контроля в финансово-кредитной сфере**;</p> <p>Налоговый комплаенс**;</p> <p>Антимонопольный комплаенс**;</p> <p>Техника проведения внутреннего корпоративного расследования**;</p> |
| ОПК-2 | Способен применять продвинутые инструментальные методы экономического анализа в прикладных и/или фундаментальных исследованиях |   | <p>Научно-исследовательская работа;</p> <p>Преддипломная практика;</p> <p>Internal Control;</p> <p>Проектирование системы комплаенс-контроля и организация ее внедрения в деятельность хозяйствующего субъекта;</p>  |

| Шифр  | Наименование компетенции  | Предшествующие дисциплины/модули, практики* | Последующие дисциплины/модули, практики*   |
|-------|---|---|--|
|       |   |   | Правовое регулирование и методология современного комплаенс-контроля;<br>Макроэкономика (продвинутый курс);  |
| ОПК-5 | Способен использовать современные информационные технологии и программные средства при решении профессиональных задач |   | Научно-исследовательская работа;<br>Преддипломная практика;<br>Internal Control;<br>Правовое регулирование и методология современного комплаенс-контроля;<br>Цифровые технологии в системе контроля; |

\* - 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) |
|--|----------------|------------|-------------|
|  |                |            | 1           |
| <i>Контактная работа, ак.ч.</i>                  | 36             |            | 36          |
| Лекции (ЛК)                                      | 18             |            | 18          |
| Лабораторные работы (ЛР)                         | 0              |            | 0           |
| Практические/семинарские занятия (СЗ)            | 18             |            | 18          |
| <i>Самостоятельная работа обучающихся, ак.ч.</i> | 54             |            | 54          |
| <i>Контроль (экзамен/зачет с оценкой), ак.ч.</i> | 18             |            | 18          |
| <b>Общая трудоемкость дисциплины</b>             | <b>ак.ч.</b>   | <b>108</b> | <b>108</b>  |
|  | <b>зач.ед.</b> | <b>3</b>   | <b>3</b>    |

## 5. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

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

| Номер раздела | Наименование раздела дисциплины                             | Содержание раздела (темы) |   | Вид учебной работы* |
|---------------|---|---------------------------|---|---------------------|
|               |   |                           |   |                     |
| Раздел 1      | Основы эконометрики   | 1.1                       | Основы эконометрики   | ЛК, СЗ              |
| Раздел 2      | Числовые характеристики статистических данных               | 2.1                       | Числовые характеристики статистических данных               | ЛК, СЗ              |
| Раздел 3      | Модель парной линейной регрессии                            | 3.1                       | Модель парной линейной регрессии                            | ЛК, СЗ              |
| Раздел 4      | Множественный регрессионный анализ                          | 4.1                       | Множественный регрессионный анализ                          | ЛК, СЗ              |
| Раздел 5      | Проверка качества уравнения регрессии и её параметров       | 5.1                       | Проверка качества уравнения регрессии и её параметров       | ЛК, СЗ              |
| Раздел 6      | Нелинейные модели регрессии и их линеаризация               | 6.1                       | Нелинейные модели регрессии и их линеаризация               | ЛК, СЗ              |
| Раздел 7      | Мульти-коллинеарность. Автокорреляция. Гетероскедастичность | 7.1                       | Мульти-коллинеарность. Автокорреляция. Гетероскедастичность | ЛК, СЗ              |
| Раздел 8      | Моделирование динамических процессов                        | 8.1                       | Моделирование динамических процессов                        | ЛК, СЗ              |
| Раздел 9      | Адаптивные методы прогнозирования                           | 9.1                       | Адаптивные методы прогнозирования                           | 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.   | Проектор и ноутбук   |
| 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. | Магнитно-маркерная доска   |
| Для самостоятельной работы | Аудитория для самостоятельной работы обучающихся (может использоваться для проведения семинарских занятий и   | 420 ауд.   |

| Тип аудитории | Оснащение аудитории  | Специализированное учебное/лабораторное оборудование, ПО и материалы для освоения дисциплины (при необходимости) |
|---------------|--|--|
|               | 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. Айвазян С. А. Эконометрика – 2: продвинутый курс с приложениями в финансах: Учеб. / С.А. Айвазян, Д. Фантацини; 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. и 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., Талышева 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. Бородин 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. Катывшев, 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](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. Елисейевой. – 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.

## 2. Журналы:

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

*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 «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/>

*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!**

## **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.



**РАЗРАБОТЧИК:**

|                             |                      |  |
|-----------------------------|----------------------|--|
| <hr/> <i>Должность, БУП</i> | <hr/> <i>Подпись</i> | <hr/> Иванченко Надежда<br>Шавкатовна<br><i>Фамилия И.О.</i> |
|-----------------------------|----------------------|--|

**РУКОВОДИТЕЛЬ БУП:**

|   |                      |  |
|---|----------------------|--|
| <hr/> Заведующий кафедрой<br><i>Должность БУП</i> | <hr/> <i>Подпись</i> | <hr/> Рагулина Юлия<br>Вячеславовна<br><i>Фамилия И.О.</i> |
|---|----------------------|--|

**РУКОВОДИТЕЛЬ ОП ВО:**

|  |                      |  |
|--|----------------------|--|
| <hr/> Заведующий кафедрой<br><i>Должность, БУП</i> | <hr/> <i>Подпись</i> | <hr/> Рагулина Юлия<br>Вячеславовна<br><i>Фамилия И.О.</i> |
|--|----------------------|--|