

Документ подписан простой электронной подписью  
Информация о владельце:  
ФИО: Ястребов Олег Александрович  
Должность: Ректор  
Дата подписания: 17.05.2024 15:59:19  
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):**

#### **МЕЖДУНАРОДНАЯ ЛОГИСТИКА**

(наименование (профиль/специализация) ОП ВО)

**2024 г.**

## 1. ЦЕЛЬ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Дисциплина «Эконометрика (продвинутый курс)» входит в программу магистратуры «Международная логистика» 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 15 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<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; |
| УК-7  | Способен к использованию цифровых технологий и методов поиска, обработки, анализа, хранения и представления информации (в профессиональной области) в условиях цифровой экономики и современной корпоративной информационной культуры | УК-7.1 Осуществляет поиск нужных источников информации и данных, воспринимает, анализирует, запоминает и передает информацию с использованием цифровых средств, а также с помощью алгоритмов при работе с полученными из различных источников данными с целью эффективного использования полученной информации для решения задач;<br>УК-7.2 Проводит оценку информации, ее достоверность, строит логические умозаключения на основании поступающих информации и данных;  |
| 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;   |

| Шифр | Компетенция | Индикаторы достижения компетенции<br>(в рамках данной дисциплины)   |
|------|-------------|---|
|      |             | 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-7 | Способен к использованию цифровых технологий и методов поиска, обработки, анализа, хранения и представления информации (в профессиональной области) в условиях цифровой экономики и современной корпоративной информационной культуры | Научно-исследовательская работа;<br>Микроэкономика (продвинутый курс);<br><i>Профессиональный иностранный язык**</i> ;<br>Таможенные аспекты перемещения товаров в международной торговле;<br><i>Конъюнктура мировых рынков товаров и услуг**</i> ;<br><i>Русский язык как иностранный в профессиональной деятельности**</i> ;<br>Профессиональный иностранный язык (факультатив);<br>Русский язык в профессиональной деятельности;<br>Экономика и организация ВЭД (продвинутый уровень); | <i>Профессиональный иностранный язык**</i> ;<br><i>Международные корпоративные стратегии маркетинга**</i> ;<br>Основы международного транспортного права;<br>Логистика закупок;<br><i>Управление проектами**</i> ;<br>Цифровые технологии в международной логистике;<br><i>Электронная торговля**</i> ;<br><i>Русский язык как иностранный в профессиональной деятельности**</i> ;<br>Профессиональный иностранный язык (факультатив);<br>Русский язык в профессиональной деятельности;<br>Преддипломная практика;<br>Научно-исследовательская работа; |
| УК-3 | Способен организовывать и руководить работой команды, вырабатывая командную стратегию для достижения поставленной цели  | Международная логистика;  | <i>Трансграничные цепочки стоимости**</i> ;<br><i>Транспортная политика международных интеграционных объединений**</i> ;<br><i>Управление проектами**</i> ;<br><i>Электронная торговля**</i> ;<br><i>Мастер-классы по международной логистике (практикоориентированный курс)**</i> ;   |

| Шифр  | Наименование компетенции   | Предшествующие дисциплины/модули, практики*  | Последующие дисциплины/модули, практики*   |
|-------|--|--|--|
| ОПК-2 | Способен применять продвинутое инструментальные методы экономического анализа в прикладных и/или фундаментальных исследованиях | Экономика и организация ВЭД (продвинутого уровня);   | <i>Преддипломная практика; Основы международного транспортного права;</i>                                  |
| ОПК-5 | Способен использовать современные информационные технологии и программные средства при решении профессиональных задач          | Экономика и организация ВЭД (продвинутого уровня);<br>Таможенные аспекты перемещения товаров в международной торговле;<br>Научно-исследовательская работа; | <i>Преддипломная практика; Научно-исследовательская работа; Основы международного транспортного права;</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           |
| <i>Контактная работа, ак.ч.</i>                  | 54             |            | 54          |
| Лекции (ЛК)                                      | 18             |            | 18          |
| Лабораторные работы (ЛР)                         | 0              |            | 0           |
| Практические/семинарские занятия (СЗ)            | 36             |            | 36          |
| <i>Самостоятельная работа обучающихся, ак.ч.</i> | 36             |            | 36          |
| <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      | Модель множественной линейной регрессии                    | 1.1                       | Метод наименьших квадратов (МНК).<br>Предпосылки Гаусса-Маркова                | ЛК, СЗ              |
|               |  | 1.2                       | Парная модель линейной регрессии   | ЛК, СЗ              |
|               |  | 1.3                       | Многофакторная модель линейной регрессии                                       | ЛК, СЗ              |
|               |  | 1.4                       | Спецификация модели. Тесты на спецификацию модели                              | ЛК, СЗ              |
|               |  | 1.5                       | Фиктивные переменные 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 | ЛК, СЗ              |
|               |  | 2.2                       | Эндогенность, инструментальные переменные                                      | ЛК, СЗ              |
|               |  | 2.3                       | Двухшаговый метод наименьших квадратов   | ЛК, СЗ              |
| Раздел 3      | Одномерные модели временных рядов                          | 3.1                       | Предпосылки моделей с временными рядами  | ЛК, СЗ              |
|               |  | 3.2                       | Стационарность. Тестирование единичных корней                                  | ЛК, СЗ              |
|               |  | 3.3                       | ARMA- и ARIMA-модели   | ЛК, СЗ              |
|               |  | 3.4                       | Условная гетероскедастичность. ARCH и GARCH модели                             | ЛК, СЗ              |
| Раздел 4      | Многомерные модели временных рядов                         | 4.1                       | Динамические модели со стационарными переменными.                              | ЛК, СЗ              |
|               |  | 4.2                       | Модели с нестационарными переменными.  | ЛК, СЗ              |
|               |  | 4.3                       | Коинтеграция. Тестирование на коинтеграцию.                                    | 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.  |  |
| Компьютерный класс | Компьютерный класс для проведения занятий, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, оснащенная персональными компьютерами (в количестве [Параметр] шт.), доской (экраном) и техническими средствами мультимедиа презентаций. | Компьютеры с установленным ПО (Excel, Eviews, R)   |
| 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. 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 «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/> Балашова Светлана<br>Алексеевна<br><i>Фамилия И.О.</i> |
|-----------------------------|----------------------|--|

**РУКОВОДИТЕЛЬ БУП:**

|   |                      |  |
|---|----------------------|--|
| <hr/> Заведующий кафедрой<br><i>Должность БУП</i> | <hr/> <i>Подпись</i> | <hr/> Балашова Светлана<br>Алексеевна<br><i>Фамилия И.О.</i> |
|---|----------------------|--|

**РУКОВОДИТЕЛЬ ОП ВО:**

|  |                      |   |
|--|----------------------|---|
| <hr/> Заведующий кафедрой<br><i>Должность, БУП</i> | <hr/> <i>Подпись</i> | <hr/> Андропова Инна<br>Витальевна<br><i>Фамилия И.О.</i> |
|--|----------------------|---|