

Документ подписан простой электронной подписью

Информация о владельце:

ФИО: Суворов Антон Дмитриевич

Должность: Ректор

Дата подписания: 21.10.2025 16:22:44

Уникальный программный ключ:

a39bdb15d680d3b0adb8e41111797118

ПРАВИТЕЛЬСТВО РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

Федеральное государственное автономное образовательное

учреждение высшего образования

«Национальный исследовательский университет»

«Высшая школа экономики» (НИУ ВШЭ)

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ  
«Эконометрика»

ID SmartPlan: 1058102

Москва, 2025

## Характеристика программы

Реализующий департамент	департамент прикладной экономики
Образовательные программы	<ul style="list-style-type: none"><li>• Совместная программа по экономике НИУ ВШЭ и РЭШ</li></ul>
Период реализации	1 модуль 2025/2026 - 2 модуль 2025/2026
Язык	<ul style="list-style-type: none"><li>• Английский</li><li>• Русский</li></ul>
Охват аудитории	для своего кампуса
Объем дисциплины	6.0 кр., 228 ч. (96 контактной работы, их них: 64 ч. лекций, 32 ч. семинары, 132 ч. самостоятельная работа)
Онлайн курс	—
Технологии реализации	<ul style="list-style-type: none"><li>• Лекции: оффлайн занятия</li><li>• Семинары: оффлайн занятия</li></ul>
Разработчики	Скроботов Антон Андреевич

Утверждение	<ul style="list-style-type: none"><li>• ОП Совместная программа по экономике НИУ ВШЭ и РЭШ   Joint HSE-NES Undergraduate Program in Economics (351118289). Номер протокола: 18. Дата заседания 2025-08-29</li></ul>
-------------	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

<https://www.hse.ru/ba/nes/courses/1071113237.html>

## **Аннотация**

Это вводный курс по эконометрике для студентов Совместной программы по экономике НИУ ВШЭ и РЭШ. В ходе курса студенты научатся применять на практике эконометрические методы для дальнейшей самостоятельной прикладной работы. Приобретенные компетенции будут полезны студентам при работе над выпускной квалификационной работой в виде самостоятельного исследования. Препреквизитами для курса являются математический анализ и математическая статистика. Наличие навыков программирования будет большим плюсом.

## **Цели освоения**

Цель курса — познакомить студентов с базовыми методами эконометрики и таким образом подготовить их к самостоятельной прикладной работе.

## **Планируемые результаты**

- познакомить студентов с основными методами эконометрики и таким образом подготовить их к их собственной прикладной работе
- Применять эконометрические методы для исследования экономических взаимосвязей и процессов
- Проверять экономические факты, теории и модели с использованием реальных данных

- Оценивать качество статистического и эконометрического анализа
- Выполнять и оценивать прогнозирование для данных временных рядов и перекрестных данных
- Понимать эконометрические методы, подходы, идеи, результаты и выводы, встречающиеся в экономических книгах и статьях
- Сбирать и корректировать реальные экономические данные для применения методов и моделей эконометрики;

Название: Введение в эконометрику и повторение теории вероятностей и статистики

Часы: лекции: 4 ч., семинары: 2 ч., самостоятельная работа: 12 ч.

Описание: Учебники: W, Глава 1 и математические повторения B и C; SW, главы 1-3; MM, Глава 1; MHE, главы 1 и 2

Название: Линейная регрессия с одним регрессором

Часы: лекции: 4 ч., семинары: 2 ч., самостоятельная работа: 12 ч.

Описание: Учебники: W, Глава 2; SW, главы 4, 5, и 18

Название: Линейная регрессия с множественными регрессорами

Часы: лекции: 8 ч., семинары: 4 ч., самостоятельная работа: 14 ч.

Описание: Учебники: W, Главы 3-5, 8, и разделы 6-1, 6-3, и 6-4; SW, главы 6, 7, и разделы 19.1-19.6; MM, Главы 2, 4, и 5; MHE, глава 3 и раздел 8.1; Hansen, Главы 2-4; Hayashi, Глава 1

Название: Нелинейные регрессионные функции.

Часы: лекции: 4 ч., семинары: 2 ч., самостоятельная работа: 12 ч.

Описание: Учебники: W, раздел 6-2 и глава 7; SW, глава 8

Название: Регрессия временных рядов и прогнозирование

Часы: лекции: 8 ч., семинары: 4 ч., самостоятельная работа: 14 ч.

Описание: Учебники: W, главы 10-12 и 18; SW, глава 15; Hayashi, Главы 2, 6, 9; Hansen, Главы 14, 15

Название: Выбор модели и методы машинного обучения: регуляризация с использованием LASSO

Часы: лекции: 8 ч., семинары: 4 ч., самостоятельная работа: 14 ч.

Описание: Учебники: Hansen, Главы 28-29; HTW, Главы 1-4

Название: Регрессия с инструментальными переменными, обобщенный метод моментов (GMM)

Часы: лекции: 8 ч., семинары: 4 ч., самостоятельная работа: 14 ч.

Описание: Учебники: W, Глава 9; SW, глава 9; W, главы 15 и 16 (опционально); SW, глава 12 и раздел 19.7; MM, главы 3 и 6; MHE, глава 4; Hayashi, Глава 3; Hansen, Главы 12-13;

Название: Регрессия с панельными данными

Часы: лекции: 8 ч., семинары: 4 ч., самостоятельная работа: 14 ч.

Описание: Учебники: W, главы 13 и 14; SW, глава 10; MHE, глава 4 и раздел 8.2

Название: Регрессия с бинарной зависимой переменной

Часы: лекции: 6 ч., семинары: 3 ч., самостоятельная работа: 14 ч.

Описание: Учебники: W, разделы 7-5 и 17-1; SW, глава 11

Название: Оценка динамических причинно-следственных эффектов

Часы: лекции: 6 ч., семинары: 3 ч., самостоятельная работа: 12 ч.

Описание: Учебники: SW, глава 16; Hansen, Глава 18

Система оценивания

Промежуточная аттестация (2025/2026 учебный год 2 модуль)

Формула оценивания: Промежуточный экзамен (Мидтерм):

Контрольная работа \* 0.200 + Финальная контрольная работа:  
Письменная работа \* 0.700 + Домашние работы: Домашнее задание \* 0.100

Правила пересдачи: В соответствии с правилами НИУ ВШЭ

Промежуточный экзамен (Мидтерм): Контрольная работа

Коэффициент: 0.200

Проводится:

– 2025/2026 учебный год 1 модуль

Учебный период, Оффлайн

Оценивается:

– 2025/2026 учебный год 1 модуль

Описание: Вес промежуточного экзамена (мидтерма) - 20% итоговой оценки

Правила пересдачи: пересдача не предполагается

Критерии оценивания: Вес промежуточного экзамена (мидтерма) - 20% итоговой оценки

Примеры заданий:

– Промежуточный экзамен (Мидтерм)

Проверяет планируемые результаты обучения:

– познакомить студентов с основными методами эконометрики и таким образом подготовить их к их собственной прикладной работе

– применять эконометрические методы для исследования экономических взаимосвязей и процессов

– проверять экономические факты, теории и модели с использованием реальных данных

– оценивать качество статистического и эконометрического анализа

– выполнять и оценивать прогнозирование для данных временных рядов и перекрестных данных

– понимать эконометрические методы, подходы, идеи, результаты и выводы, встречающиеся в экономических книгах и статьях

– собирать и корректировать реальные экономические данные для применения методов и моделей эконометрики;

Финальная контрольная работа: Письменная работа

Коэффициент: 0.700

Проводится:

– 2025/2026 учебный год 2 модуль

Сессия, Оффлайн

Оценивается:

– 2025/2026 учебный год 2 модуль

Является экзаменом

Пересдача: возможна

Правила пересдачи: В случае пропуска финальной контрольной работы по уважительной причине, пересдача проводится по

согласованию с преподавателем в соответствии с правилами пересдач НИУ ВШЭ.

Критерии оценивания: Оценка за тест выставляется из 100 баллов. Вес каждого задания оговаривается в работе.

Примеры заданий:

– Финальный тест

final 2019 (1).pdf

Проверяет планируемые результаты обучения:

- познакомить студентов с основными методами эконометрики и таким образом подготовить их к их собственной прикладной работе
- применять эконометрические методы для исследования экономических взаимосвязей и процессов
- проверять экономические факты, теории и модели с использованием реальных данных
- оценивать качество статистического и эконометрического анализа
- выполнять и оценивать прогнозирование для данных временных рядов и перекрестных данных
- понимать эконометрические методы, подходы, идеи, результаты и выводы, встречающиеся в экономических книгах и статьях
- собирать и корректировать реальные экономические данные для применения методов и моделей эконометрики;

Домашние работы: Домашнее задание

Коэффициент: 0.100

Проводится:

– 2025/2026 учебный год 2 модуль

Учебный период, Оффлайн

Оценивается:

– 2025/2026 учебный год 2 модуль

Описание: Запланировано несколько домашних работ с максимальным весом 10%

Критерии оценивания: Оценка за тест выставляется из 100 баллов. Вес каждого задания оговаривается в работе.

Примеры заданий:

– Problem set (Набор задач)

problem set 1.pdf

Проверяет планируемые результаты обучения:

- познакомить студентов с основными методами эконометрики и таким образом подготовить их к их собственной прикладной работе
- применять эконометрические методы для исследования экономических взаимосвязей и процессов
- проверять экономические факты, теории и модели с использованием реальных данных
- оценивать качество статистического и эконометрического анализа

- выполнять и оценивать прогнозирование для данных временных рядов и перекрестных данных
- понимать эконометрические методы, подходы, идеи, результаты и выводы, встречающиеся в экономических книгах и статьях
- собирать и корректировать реальные экономические данные для применения методов и моделей эконометрики;

Информация об элементах контроля, которые не входят в расчет оценки

Промежуточный экзамен (Мидтерм): Контрольная работа

Проводится:

Учебный период, Оффлайн

Описание: Вес промежуточного экзамена (мидтерма) - 30% итоговой оценки

Пересдача: возможна

Правила пересдачи: Организуется в соответствии с правилами пересдач НИУ ВШЭ

Критерии оценивания: -

Итоговая оценка

Формула оценивания: Итоговая оценка рассчитывается по формуле промежуточной аттестации за 2025/2026 учебный год 2 модуль

# Литература

## Основная литература

1. Введение в эконометрику : учебник для вузов, Сток, Дж.978-5-7749-0865-32015
2. Econometric analysis of cross section and panel data, eng : англ.Wooldridge, J. M.0-262-23219-72002
3. Econometrics, eng : англ.Hayashi, F.0-691-01018-82000
4. Introduction to econometrics, eng : англ.Stock, J. H.03214425392007
5. Statistical learning with sparsity : the lasso and generalizations, eng : англ.Hastie, T.97803677383342020

## Дополнительная литература

1. Introduction to econometrics, eng : англ.Dougherty, C.978-0-19-956708-92011

## Основные электронные ресурсы

1. Bruce E. Hansen. (2013). Econometrics. Retrieved from <http://search.ebscohost.com/login.aspx?direct=true&site=eds-live&db=edsbas&AN=edsbas.C0DB9E1E>
2. Wooldridge, J. M. . (DE-588)131680463, (DE-576)298669293. (2006). Introductory econometrics : a modern approach / Jeffrey M. Wooldridge. Mason, Ohio [u.a.]: Thomson/South-Western. Retrieved from <http://search.ebscohost.com/login.aspx?direct=true&site=eds-live&db=edswao&AN=edswao.250894459>

## Программное обеспечение

Наименование	Характеристика
Anaconda Community	Пакеты Python для науки, математики, инженерии и анализа данных
R	Язык программирования для статистических вычислений и графики
Python	Среда разработки
Яндекс.Документы	Офисное ПО

# **Материально-техническое обеспечение**

## **Тип аудиторий**

- Лекционные
- Семинарские

## **Оснащение аудиторий**

- Персональный компьютер
- Набор демонстрационного оборудования - Может включать в себя: мультимедийный проектор, проекционный экран, интерактивная доска, видео панель, интерактивная видео панель, презентационный ноутбук и другие средства демонстрации учебного контента. Допускается использование для проведения занятий переносного набора демонстрационного оборудования.
- Доска
- Экран
- Специализированная мебель - Доска, столы или парты, стулья.
- Наличие беспроводного доступа в Интернет по сети Wi-Fi

## **Особенности организации дисциплины**

В случае необходимости, обучающимся из числа лиц с ограниченными возможностями здоровья (по заявлению обучающегося) а для инвалидов также в соответствии с индивидуальной программой реабилитации инвалида, могут предлагаться следующие варианты восприятия учебной информации с учетом их индивидуальных психофизических особенностей, в том числе с применением электронного обучения и дистанционных технологий:

Обучение по образовательным программам обучающихся с ограниченными возможностями здоровья осуществляется с учетом особенностей психофизического развития, индивидуальных возможностей и состояния здоровья таких обучающихся. Образование обучающихся с ограниченными возможностями здоровья может быть организовано как совместно с другими обучающимися, так и в отдельных группах.

В случае необходимости (по заявлению обучающегося) создаются специальные условия для получения им высшего образования по образовательным программам.

Под специальными условиями для получения высшего образования по образовательным программам обучающимися с ограниченными возможностями здоровья понимаются условия обучения, воспитания и развития таких обучающихся, включающие в себя использование специальных образовательных программ и методов обучения и воспитания, специальных учебников, учебных пособий и дидактических материалов, специальных технических средств обучения коллективного и индивидуального пользования, предоставление услуг ассистента (помощника), оказывающего обучающимся необходимую техническую помощь, проведение групповых и индивидуальных коррекционных занятий, обеспечение доступа в здания организаций и другие условия, без которых невозможно или затруднено освоение образовательных программ обучающимися с ограниченными возможностями здоровья.

При получении высшего образования по образовательным программам обучающимся с ограниченными возможностями здоровья предоставляются бесплатно специальные учебники и учебные пособия, иная учебная литература, а также услуги сурдопереводчиков и тифлосурдопереводчиков.

В целях доступности получения высшего образования по образовательным программам лицами с ограниченными возможностями здоровья обеспечивается:

1. Для лиц с ограниченными возможностями здоровья по зрению:

- наличие альтернативной версии официального сайта организации в информационно-телекоммуникационной сети "Интернет" для слабовидящих;
- размещение в доступных для обучающихся, являющихся слепыми или слабовидящими, местах и в адаптированной форме (с учетом их особых потребностей) справочной информации о расписании учебных занятий (информация должна быть выполнена крупным рельефно-контрастным шрифтом (на белом или желтом фоне) и продублирована шрифтом Брайля);
- присутствие ассистента, оказывающего обучающемуся необходимую помощь;
- обеспечение выпуска альтернативных форматов печатных материалов (крупный шрифт или аудиофайлы);
- обеспечение доступа обучающегося, являющегося слепым и использующего собаку-проводника, к зданию организации;

2. Для лиц с ограниченными возможностями здоровья по слуху:

- дублирование звуковой справочной информации о расписании учебных занятий визуальной (установка мониторов с возможностью трансляции субтитров (мониторы, их размеры и количество необходимо определять с учетом размеров помещения));
- обеспечение надлежащими звуковыми и визуальными средствами воспроизведения информации;

3. Для лиц с ограниченными возможностями здоровья, имеющих нарушения опорно-двигательного аппарата материально-технические условия должны обеспечивать возможность беспрепятственного доступа обучающихся в учебные помещения, столовые, туалетные и другие помещения, а также пребывания в указанных помещениях (наличие пандусов, поручней, расширенных дверных проемов, лифтов, локальное понижение стоек-барьеров, наличие специальных кресел и других приспособлений).