**Аннотация дисциплины**

**Эконометрика (продвинутый уровень)**

Рабочая программа дисциплины предназначена для студентов, обучающихся по направлению 38.04.01 «Экономика» направленность программы магистратуры «Бизнес-аналитика», заочная форма обучения.

Цель дисциплины: формирование у студентов современных теоретических знаний и практических навыков в области спецификации, оценивания и проверки адекватности регрессионных моделей финансово-экономических объектов, достаточных для изучения всех специальных и прикладных дисциплин учебных программ, а также проведения собственных научных исследований в финансово-экономической сфере.

Место дисциплины в структуре ООП - дисциплина «Эконометрика (продвинутый уровень)» является дисциплиной части, формируемой участниками образовательных отношений модуля дисциплин инвариантных для направления подготовки, отражающих специфику филиала по направлению подготовки 38.04.01 «Экономика», направленность программы магистратуры «Бизнес-аналитика».

Краткое содержание:

Эконометрика, её задача и метод. Основные этапы эконометрического исследования. Необходимые сведения из теории вероятностей и математической статистики. Характеристики и модели временных рядов. Линейная модель множественной регрессии и оптимальные статистические процедуры оценивания её параметров. Тестирование предпосылок теоремы Гаусса-Маркова. Линейные регрессионные модели с гетероскедастичными и автокоррелированными остатками. Прогнозирование значений эндогенной переменной линейной модели, проверка её адекватности и ошибки спецификации. Модели с лаговыми переменными, проблема мультиколлинеарности в ЛММР и методика её устранения. Линейные эконометрические модели из одновременных уравнений.