

## DOKTORANTŪROS STUDIJŲ DALYKO SANDAS

Dalyko pavadinimas	Mokslo kryptis (šaka) kodas	Fakultetas	Katedra
<b>Ekonometrija</b>	Socialiniai mokslai, Ekonomika (04S)	Ekonomikos fakultetas	Kiekybinių metodų ir modeliavimo katedra

Dalyko apimtis kreditais	Visas studijuojančio darbo krūvis	Kontaktinio darbo valandos	Savarankiško darbo valandos
<b>7</b>	<b>196</b>	<b>16</b>	<b>180</b>

### Dalyko anotacija

#### ***Dalyko anotacija, tikslas***

Ekonometrijos dalyko tikslas – suteikti doktorantui žinias, būtinas empirinio tyrimo atlikimui. Šis dalykas rekomenduojamas tiems doktorantams, kurie naudos ekonometrinius metodus, rašydami daktaro disertaciją ir kuriems reikalingas kvalifikuotas jų atliekamų tyrimų įvertinimas ir konstruktyvūs patarimai.

Labai apibendrintai, doktorantams, atsižvelgiant į analizuojamos temos specifiką, siūlomos alternatyvos – pasirinkti makroekonometrijos arba mikroekonometrijos dalyko kryptį; nors galimas ir trečias variantas, apimantis atskiras temas iš makro ir mikro analizės. Dalyko turinys lanksčiai priderinamas prie kiekvieno doktoranto nagrinėjamos problemos, todėl šiame apraše pateikiamos temos yra orientacinio pobūdžio.

#### ***Makroekonometrijos kryptis***

Makroekonometrijos kryptis yra orientuota į netiesinių procesų modeliavimą ir daugiamačius makroekonominius modelius. Netiesinių procesų studijų šerdis būtų C. W. J. Granger ir T. Teräsvirta knyga „Modelling Nonlinear Economic Time Series“, papildant ją vėlesnio, išplėsto leidimo medžiaga, o empirinio daugiamačių procesų modeliavimo studijos atsiremtų į K. Juselius „The Cointegrated VAR model“ bei D. Hendry „Dynamic Econometrics“ monografijas.

#### ***Turinys (temos)***

##### 1. Dinaminė ekonometrija

- Monte Carlo
- Dinamika ir tarpusavio priklausomybė
- Egzogeniškumas ir priežastingumas
- Tiesinio modelio interpretavimas
- Dinaminės sistemos

##### 2. Kointegravimas

- Kointegruoto VAR modelio specifikavimas
- Konstantiškumo testai
- Apribojimų, tenkančių kointegruojantiems vektoriams ir korekcijos greičio koeficientams, tikrinimas
- Ilgo laikotarpio ir trumpo laikotarpio struktūros identifikavimas
- Kointegravimas su I(2) kintamaisiais

##### 3. Netiesiškumas

- Netiesiškumo koncepcija
- Specifiniai netiesiniai modeliai (GAR, BL, TAR, STR ir t.t.)
- Ilgos atminties modeliai
- Netiesinės vienetinės šaknys
- Netiesinis kointegravimas ir netiesiniai daugiamačiai modeliai

### ***Mikroekonometrijos kryptis***

Mikroekonometrijos kryptyje (skerspjūvio ir panelinių duomenų analizė) pagrindiniu vadovu būtu A. Colin Cameron bei P. K. Trivedi „Microeconometrics“, papildant jį J. M. Wooldridge „Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data“ ir W. H. Greene „Econometric Analysis“ temomis.

*Turinys (temos)*

#### 1. Skerspjūvio duomenų modeliai

- Binarinio atsako modeliai
- Multinominiai modeliai
- Tobitai
- Išlikimo analizė

#### 2. Panelinių duomenų modeliai

- Tiesiniai paneliniai modeliai
- Netiesiniai paneliniai modeliai

### ***Atsiskaitymo tvarka***

Egzaminas (50% galutinio įvertinimo) ir savarankiškas tiriamasis darbas (50% galutinio įvertinimo). Savarankiško tyrimo tematiką doktorantas suderina su konsultuojančiais dėstytojais, o rezultatus (referatą arba mokslinį straipsnį ir reprodukuojamą programinį kodą su duomenimis) pateikia ne vėliau kaip likus dviem savaitėm iki egzamino. Orientacinė referato apimtis 20-30 psl.

#### Pagrindinė literatūra

C. W. J. Granger, T. Teräsvirta. Modelling Nonlinear Economic Time Series. Oxford University Press, 1993.

C. W. J. Granger, D. Tjøstheim, T. Teräsvirta. Modelling Nonlinear Economic Time Series. Oxford University Press, 2011.

K. Juselius. The Cointegrated VAR model. Oxford University Press, 2006.

D. Hendry. Dynamic Econometrics. Oxford University Press, 1995.

A. Colin Cameron, P. K. Trivedi. Microeconometrics. Cambridge University Press, 2005.

Badi H. Baltagi. Econometric Analysis of Panel Data. 5<sup>th</sup> ed. Wiley, 2013.

J. M. Wooldridge. Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data. 2<sup>nd</sup> ed. MIT Press, 2010.

W. H. Greene. Econometric Analysis. 7<sup>th</sup> ed. Prentice Hall, 2011.

Konsultuojančiųjų dėstytojų vardas, pavardė	Pareigos, mokslo laipsnis
<b>Vita Karpuškienė</b>	<b>Doc. dr.</b>
Svarbiausieji darbai mokslo kryptyje (šakoje) paskelbti per pastaruosius 5 metus	
Karpuškienė V. Social and economic consequences of the recent minimum wage rise in Lithuania. – Ekonomika. Mokslo darbai 94(2), 2015.	
Karpuškienė V. Minimalios algos padidinimo iki 1000 Lt. padariniai. Tarptautinė mokslinė praktinė konferencija „Mokslo ir verslo dermė“ vykusi 2014 gegužės 29 d. Konferencijos medžiagos elektroninė versija ISBN 978-609-95215-9-6.	
Karpuškienė V. The Impact of Minimum Wage on the Labour Market of Lithuania. – Ekonomika. Mokslo darbai 90(2), 2011.	
Konsultuojančiųjų dėstytojų vardas, pavardė	Pareigos, mokslo laipsnis
<b>Algirdas Bartkus</b>	<b>Doc. dr.</b>
Svarbiausieji darbai mokslo kryptyje (šakoje) paskelbti per pastaruosius 5 metus	
Bartkus A. Efektyvus socialinio draudimo pensijų indeksavimas. – Lietuvos statistikos darbai 49, 2010, 34–39.	
Bartkus A. Antros pakopos kaupiamųjų pensijų fondų poveikis makroekonomikai. – Taikomoji ekonomika: sisteminiai tyrimai 5(1), 2011, 145–160.	
Bartkus A. Ilgalaisis socialinio draudimo reformų poveikis socialinio draudimo biudžeto stabilumui. – Taikomoji ekonomika: sisteminiai tyrimai 6(2), 2012, 179–195.	
Bartkus A. On Future Pensions from the Second Pillar Pension Funds. – Organizations	

and Markets in Emerging Economies 1(7), 2013, 121–140.

Socialinis draudimas Lietuvoje: kontekstas, raida, rezultatai. Red. R. Lazutka, Socialinių tyrimų centras, 2013, 252–273.

Bartkus A. The analysis of the second pillar pension funds and the role of expectations. – Organizations and Markets in Emerging Economies 2(10), 2014, 44–58.

Doktorantūros komiteto teikimu patvirtinta Ekonomikos fakulteto taryboje  
2015 m. lapkričio mėn. 10 d. , protokolo Nr. 190000/TP - 09(152)

Tarybos pirmininkas

Pastaba: jei doktorantūros teisė bus suteikta kartu su kita institucija, tvirtinama ne fakulteto taryboje, o jungtinėje komisijoje.