**Ekonometrijos paskaitų kurso programa**

**Paskaitos: Antradieniais 12.00-13.30 val. 305/308 auditorijoje**

**Pratybos: Antradieniais 14.00- 15.30 val. 308a.**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
|  | **Tema** | **Pagrindiniai klausimai** |
| **2018-09-04** | **Įvadinė paskaita** | **Ekonometrikos II kurso pristatymas:**   * **Programa, darbas pratybose, žinių vertinimas** * **Kartojimas: veiksmai su matricomis** |
| **2018-09-11** | **Laiko eilučių analizė**  **Glodinimo technikos** | * **Laiko eilutės samprata** * **Klasikinis laiko eilutės išskaidymas** * **Eksponentinis glodinimas** |
| **2018-09-18** | * **Stacionarumo sąvoka** * **Filtrų samprata** * **Laiko eilučių prognozavimas** |
| **2018-09-25** | **Laiko eilučių analizė**  **ARMA/ARIMA/ ARIMAX modeliai** | * **ARMA/ARIMA/ARIMAX modelių grupė** * **AR (autoregresinis) procesas** * **MA (slenkančių vidurkių) procesas** |
| **2018-10-02** | * **Box-Jenkins procedūra** |
| **2018-10-09** | * **Box-Jenkins procedūra** |
| **2018-10-16** | * **Prognozavimas ARMA/ARIMA/ARIMAX modeliu** |
| **2018-10-30** | **Laiko eilučių analizė**  **ARMA/ARIMA modelių pavyzdžiai** | **Studentų prisatymai** |
| **2018-11-06** | **Panelinių duomenų modeliai** | * **Panelinių duomenų modelių samprata ir privalumai** * **Koeficientų vertinimo būdai: bendros konstantos metodas** |
| **2018-11-13** | * **Fiksuoto ir atsitiktinio efekto metodai** |
| **2018- 11-20** | * **Dinaminiai panelinių duomenų modeliai** |
| **2018-11-27** | **VAR (Vektorinės autoregresijos modeliai) ir priežastingumo testai** | * **VAR modelio sudarymas** * **Modelio parametrų vertinimas** * **Modelio adekvatumo tikrinimas** |
| **2018-12-04** | * **Granger priežastingumo įvertinimas** * **Reakcija į impulsus** * **Dispersijos dekompozicija** |
| **2018-12-11** | **VAR modelio sudarymas** |
| **2018-12-18** | **Kurso apibendrinimas** |  |

**Literatūra**

***Pagrindinė literatūra***

1. Asteriou D.Applied Econometrics A Moderm approach using EWievs and Microfit. Palgrave Macmilan, 2008
2. Enders W. Applied Econometric Time Series (3 ed.) New York, Wiley&Sons http://public.econ.duke.edu/~boller/Econ.883/Enders.pdf
3. Gujarati D.N. Porter D.C. *Basic Econometrics*. McGraw-Hill Inc, 2009
4. VU MIF internetinis puslapis „Statistika ir Ekonometrija

<http://www.statistika.mif.vu.lt/atsisiuntimui/konspektai/>

1. R. Lapinskas. Practical Econometrics II. Time Series Analysis (Lecture Notes), 2013, Vilnius, 166 p.
2. Virmanto Kvedaro (MIF Ekonometrinės analizės katedra) Taikomoji laiko eilučių ekonometrija. Paskaitų konspektas http://web.vu.lt/mif/v.kvedaras/files/2013/09/Konspektas\_2005.pdf

***Kiti šaltiniai***

1. Maddala G.S., Kajal Lahiri Introduction to econometrics Willey visi leidimai (2010 irkt.)
2. Wooldridge J.M. Introductory econometrics: a modern approach. Thomson, 2010, 2009, 2006 ir kt.
3. Makridakis S., Wheelwright S.C., Hyndman R.J., Forecasting. Methods and applications John Wiley and Sons,
4. Green H. W. Econometric Analysis, International Editon, 2000
5. Martišius S.A., Kėdaitis Statistika 1, VUL, Vilnius, 2010

**Vertinimas**

|  |  |
| --- | --- |
| Atsiskaitymo forma | Balai |
| Egzaminas (testas su uždarais ir atvirais klausimais) | 5 |
| Atsiskaitymas už pratybas:  Laiko eilučių tyrimas  Panelinių duomenų modelis  VAR modelis | 5 balai (2 +2+1)  2  2  1 |
| Papildomi balai (teigiami) |  |
| Pranešimai paskaitose  Eviews arba R konsultantai ( grupės studentas) | 0,5 balo  Max 2 |
| Neigiami balai |  |
| Neatliktos 2 ir daugiau pratybų užduotys | -1 |