

V. Maniušis

. Neuroniniai tinklai, struktūriniai pasikeitimai ir vertybiniai popieriai (2 stud.)

. Vizuali duomenų analize su Ggobi (2 stud.)

G. Murauskas

HLM modelių taikymas

HLM --- hierarchiniai tiesiniai modeliai;

Tikslai:

- 1) susipažinti su HLM sąvokomis, apibrėžimais;
- 2) išmokyti naudoti R paketą HLM analizei;
- 3) atlikti ekonometrinių duomenų analizę (duomenis susirandant patiems) taikant HLM modelį.

Darbas gali būti keliolikai studentų; reiktų pasirinkti skirtingas duomenų aibes.

D. Zuokas

Perkamosios galios pariteto ekonometrinis tyrimas (2 studentai)

Palūkanų normos pariteto ekonometrinis tyrimas (2 studentai)

1. Namų ūkių pajamų tyrimas

R. Lapinskas

Namų ūkių pajamų tyrimas

Panagrinti knygą Modelling Income Distribution. Paimti mėnesinius duomenis namų ūkių pajamų duomenis iš Lietuvos statistikos departamento. Aprašyti duomenų rinkimo metodiką. Ištirti duomenis (kokių skirstinių aprašomi mėnesiniai duomenys? ar mėnesinių duomenų parametrai keičiasi? gal yra koks sezoniškumo efektas?) Chi kvadrato, Anderseno, Bagdonavičiaus kriterijai apie mėnesinių skirstinių pastovumą. Nustatyti metinių pajamų tendą.

Laikinėms sekoms skirtų R paketų apžvalga

Laikinių sekų objektai yra gana specifiniai, kadangi stebėjimo reikšmės yra glaudžiai surištos su stebėjimo laiko momentais (datomis). Pvz., analizuojant akcijų kainos kitimą vertybinių popierių biržoje, kalendoriaus problemos dažnai sukelia nemažai sunkumų (nevienodo ilgio mėnesiai, savaitgalio ir šventinės dienos ir pan.). R yra keli paketai skirti darbui su laikinėmis sekomis. Tai paketai zoo, its, fCalendar, fSeries, tframe, PerformanceAnalytics ir kiti. Darbo tikslas yra išsiaiškinti ir aprašyti šių paketų galimybes ir pateikti darbo su jais pavyzdžius.

A95 benzino poreikio Lietuvoje tyrimas

Darbo tikslas: nustatyti nuo ko priklauso benzino poreikis Lietuvoje per capita? Nuo jo kainos? Dujų kainos? Automobilių skaičiaus? Gyventojų skaičiaus? Vidutinio darbo užmokesčio? Lietuvos ekonomikos indekso? Nedarbo lygio? Metų numerio (trendas)? O kaip yra Vokietijoje ar kur nors kitur?

V. Čekanavičius

Augimo modeliai

Ekonominio augimo modelių koeficientų ekonometriniai įverčiai arba panelinių duomenų analizės atskiras atvejis.

MIF studentu sociologinis tyrimas.

Reikės apklausti 100 mif studentų, nustatyti jų socioekonominę statusą ir jų pažymius ar pirkimo įpročius, ar muzikinį skonį (ką matuoti pasirinkti reikės patiems) ir sudaryti paprastą regresijos ar (ir) logistinės regresijos modelį.

V. Kvedaras

Infrastruktūros ekonominių rodiklių prognozavimui ir skelbimui sukūrimas. (5-6 studentai)

R. Leipus

Finansinių rodiklių modeliavimas

V. Zemlys

Euro įtaka tarpusavio prekybai

Ar įvedus eurą pasikeitė tarpusavio prekyba šalyse įsivedusiose eurą? Pasikeitimo uždavinys.

Prof. Alfredas Račkauskas

Infliacijos matavimas ir tytimai. (2-3 studentai)

Išsiaiškinti infliacijos apibrėžimus ir skaičiavimo metodikas. Perskaityti straipsnį :

T. Cogley. A simple adaptive measure of core inflation.

Pagal galimybes, straipsnyje pateikiamą metodologiją, adaptuoti Lietuvos ekonomikai.

Biržos duomenų agregavimas ir analizė. (2-3 studentai)

Susipažinti su duomenų agregavimu. Išsiaiškinti, kokie galimi statistinių charakteristikų pasikeitimai agreguojant duomenis. Skaičiavimams atlikti bus pateikti konkretūs duomenys.

Dmitrij Celov

Duomenų tarplaikinio agregavimo poveikis makroekonominiams duomenims. 1-2 studentai

Komentarai: makroekonominiai duomenys, jų surinkimas, laiko eilučių dažnumas, laiko eilučių charakteristikos savybės ((dalinė)autokorelecine struktūra, vienetinė saknis, normaliskumas, ...), jų pasikeitimai kai pereinama prie platesnio laikotarpio, poiliustruoti viska Lietuvos makroekonominiais rodikliais

Duomenų tarplaikinio deagregavimo metodų palyginimas. 1-2 studentai

Komentarai: išsiaiškinti paprastus deagregavimo metodus, splainai, polinominės interpoliacijos ir t.t. kaip elgiamasi su srautų ir lygių rodikliais, panagrinėti sudetingesnius deagregavimo metodus, analizę pagrįsti imitaciniais eksperimentais bei realiomis duomenimis.

Gamybos -snaudų lentelių vaidmuo makroekonominiame modeliavime. 1-3 studentai

Komentarai: Išsiaiškinti kas yra Gamybos-snaudų (input-output) lentelės, išsiaiškinti ekonometrinių ir bendrosios pusiausvyros modelių skirtumus, panašumus, stiprias ir silpnas puses, OECD šalių lentelių pavyzdžiu pademonstruoti kaip juos galima taikyti ūkio plėtros analizėje, keletai šalių sudaryti nesudėtingą (Leontievo gamybos funkcija) bendrosios pusiausvyros modelį.

Rimas Norvaiša

Ekonominio rodiklio BVP ir jo variantu tyrimas.

Rodiklio apibudinimas ir jo reikšmė ekonomikai. Lietuvos BVP duomenų rinkimas. Duomenų statistine analize.

Palukanų normos.

Rodiklio apibudinimas ir jo reikšmė ekonomikai. Lietuvos ir kitos šalies duomenų rinkimas. Duomenų statistine analize.

Infliacija.

Rodiklio apibudinimas ir jo reikšmė ekonomikai. Lietuvos ir kitos šalies duomenų rinkimas. Duomenų statistine analize.

Aušra Maldeikienė

Paskolų namų ūkiams apimties didėjimo įtaka vartojimui

Struktūriniai paskolų veiklos rūšims pokyčiai nuo 1997 iki 2007 metų

Marijus Radavičius

Pragyvenimo lygis ir vartojimo struktūra.

Apklauskos duomenų analize ir jos panaudojimas paklauskos tyrimuose.

Daugiafaktorinio produktyvumo palyginamoji analize.

Socialines nelygybes matavimas ir analize.

Imonių raidos ekonometrinis tyrimas