

DOKTORANTŪROS STUDIJŲ DALYKO SANDAS

Dalyko pavadinimas	Mokslų kryptis (šaka) kodas	Fakultetas	Katedra
Ekonometrijos rinkiniai skyriai	Ekonomika S 004	Ekonomikos ir verslo fakultetas	

Studijų būdas	Kreditų skaičius ECTS	Studijų būdas	Kreditų skaičius
paskaitos		konsultacijos	
individualus		seminarai	

Struktūra, val.					Iš viso val.	Kred.
Paskaitų	Pratybų	Laboratorinių darbų	Konsultacinių seminarų	Savarankiško darbo		
16	0	16	32	96	160	6

Dalyko anotacija	
<p>Pateikiama išsami įvairių ekonometrijos terminų sampratų ir metodų apžvalga. Ugdomi gebėjimai tinkamai apibrėžti tyrimo klausimus ir taikyti įvairius pažangius ekonometrinius metodus naudojant R programavimo kalbą.</p> <p>Pagrindinis tikslas: gilinti teorinius bei praktinius pažangius ekonometrinių modelių taikymo įgūdžius.</p> <p>Siekiami modulio studijų rezultatai:</p> <ol style="list-style-type: none"> Geba demonstruoti sisteminių požiūrį į ekonomikos procesus, juos aprašyti ekonometriniais modeliais. Geba parinkti ir įvertinti ekonometrinių modelių ekonominių rodiklių modeliavimui. Geba išspręsti ekonometrinių modelių naudojantis R ir kitomis specialiosiomis kompiuterinėmis programomis ir interpretuoti rezultatus. Geba naudotis moksline literatūra ir įvairiais duomenų šaltiniais nagrinėjant ekonomikos problemas. <p>Dalys (skyriai) ir temos:</p> <ol style="list-style-type: none"> Bendroji ekonometrija <ol style="list-style-type: none"> Pagrindinės statistikos sąvokos ir jų savybės Mažiausių kvadratų metodas ir Gauso Markovo teorema Priežastingumas ir regresija Mikroekonometrija <ol style="list-style-type: none"> Problemos regresijos modeliuose Mikroekonominių duomenų rinkinių struktūra Apklausų dizainas ir regresija Makroekonometrija <ol style="list-style-type: none"> Laiko eilutės, autoregresijos modeliai ir Grangerio priežastingumas Laiko eilučių stacionarumas ir prognozavimas Dinaminiai priežastingumo efektai Vektorinė autoregresija Panelinių duomenų modeliai <ol style="list-style-type: none"> Panelinių duomenų privalumai Statinis tiesinis modelis Modelio parinkimo kriterijai Dinaminiai paneliniai modeliai 	
Pagrindinė literatūra	
<ol style="list-style-type: none"> Min, Ch. K. Applied econometrics: a practical guide. London: Routledge. 2019 Racine, J. S. Reproducible econometrics using R. New York: Oxford University Press. 2019 Sul, D. Panel data econometrics: common factor analysis for empirical researchers. London: Routledge. 2019 Stachurski, John: A Primer in Econometric Theory, The MIT Press, 2016. 	

5. Stock, J. H., & Watson, M. W. Introduction to Econometrics. Boston: Pearson/Addison Wesley. 2007
6. Cameron, A. C., & Trivedi, P. K. Microeconometrics: methods and applications. Cambridge university press. 2005
7. Fuleky, P. (Ed.). (2020). Macroeconomic forecasting in the era of big data : theory and practice. Cham : Springer International Publishing.
8. Tsionas, M. (Ed.). (2019). Panel data econometrics: theory. London : Elsevier.
9. Angrist, J., & Steffen-Pischke, J. Mastering Metrics, 2015.

Konsultuojančiųjų dėstytojų vardas, pavardė	Mokslo laipsnis	Svarbiausieji darbai mokslo kryptyje (šakoje) paskelbti per pastaruosius 5 metus
Povilas Lastauskas	Dr.	<p>1. Lastauskas, P., & Stakenas, J. (2018). Structural labour market reforms in the EU-15: Single-country vs. coordinated counterfactuals. Structural Change and Economic Dynamics, 44, 88-99.</p> <p>2. Lastauskas, P., & Stakenas, J. (2018). Openness and Structural Labor Market Reforms: Ex Ante Counterfactuals. Contemporary Economic Policy, 36(4), 723-757.</p> <p>3. Constantinescu, M., & Lastauskas, P. (2018). The knotty interplay between credit and housing. The Quarterly Review of Economics and Finance, 70, 241-266.</p>
Swapnil Singh	Dr.	<p>1. Emergence of Subprime Lending in Minority Neighborhoods (2021, Bank of Lithuania Working Paper)</p> <p>2. Bowling Alone, Buying Alone: The Decline of Co-borrowers in the US Mortgage Market (2020, Bank of Lithuania Working Paper)</p> <p>3. Economic Development, the Nutrition Trap and Metabolic Disease (2021, NBER Working Paper)</p> <p>4. Mortgage Foreclosure Risk after the Great Recession (2018, Bank of Lithuania Working Paper)</p> <p>5. Optimal Monetary Policy under Sector Interconnections (2018, Netherlands Economic Review)</p> <p>6. Consumption Insurance with Advance Information (2020, Quantitative Economics)</p>
Soroosh Soofi Siavash	Dr.	<p>1. Moench, E., & Siavash, S. S. (2022). Carbon Intensity, Productivity, and Growth.</p> <p>2. Moench, E., & Siavash, S. S. (2022). What Moves Treasury Yields?, forthcoming in Journal of Financial Economics.</p>

		<p>3. Siavash, S. S. (in progress). On the Macroeconomic Effects of Intermediaries Balance Sheet Shocks: Sectoral Propagation</p> <p>4. Siavash, S. S., Binder, M. (2017). Measuring Global Financial Connectedness</p> <p>5. Siavash, S. S (2018). Dominant U.S. Manufacturing Sectors: A Factor Model Analysis</p>
Alina Stundžienė	Dr.	<p>1. [S1; CH; OA] Stundziene, Alina; Baliute, Asta. Personnel costs and labour productivity: the case of European manufacturing industry // <i>Economies</i>. Basel : MDPI. ISSN 2227-7099. 2022, vol. 10, iss. 2, art. no. 31, p. 1-17. DOI: 10.3390/economies10020031. [Emerging Sources Citation Index (Web of Science); Scopus; DOAJ] [CiteScore: 2,40; SNIP: 1,128; SJR: 0,445; Q2 (2020, Scopus Sources)] [M.kr.: S 004] [Indėlis: 0,500]</p> <p>2. [S1; GB; OA] Grybauskas, Andrius; Pilinkienė, Vaida; Stundžienė, Alina. Predictive analytics using Big Data for the real estate market during the COVID-19 pandemic // <i>Journal of Big Data</i>. London : Springer Nature. ISSN 2196-1115. 2021, vol. 8, iss. 1, art. no. 105, p. 1-20. DOI: 10.1186/s40537-021-00476-0. [Emerging Sources Citation Index (Web of Science); Scopus; MEDLINE] [CiteScore: 8,60; SNIP: 3,478; SJR: 1,031; Q1 (2020, Scopus Sources)] [M.kr.: S 004] [Indėlis: 0,333]</p> <p>3. [S1; CH] Abramavičius, Silvijus; Stundžienė, Alina; Korsakova, Laura; Venslauskas, Mantas; Stankevičius, Edgaras. Stock price reaction to the drug development setbacks in the pharmaceutical industry // <i>DARU journal of pharmaceutical sciences</i>. Cham : Springer. ISSN 2008-2231. 2021, vol. 29, iss. 1, p. 1-11. DOI: 10.1007/s40199-020-00349-6. [Science Citation Index Expanded (Web of Science); Scopus; MEDLINE] [CiteScore: 3,60; SNIP: 0,912; SJR: 0,645; Q3 (2020, Scopus Sources)] [M.kr.: M 001, S 004] [Indėlis: 0,200]</p> <p>4. [S1; ES; OA] Stundžienė, Alina; Mihi-Ramirez, Antonio; Navarro Pabsdorf, Margarita. Flaws in the European Monetary Union. Does the EMU need a solution? = Las carencias de la Unión Monetaria Europea. ¿necesita la UEM una solución? // <i>Revista de Economía Mundial</i>. Huelva : Universidad de Huelva. ISSN 1576-0162. eISSN 2340-4264. 2020, vol. 55, p. 79-96. DOI: 10.33776/rem.v0i55.3851. [Social Sciences Citation Index (Web of Science); Scopus; DOAJ] [IF: 0,380; AIF: 2,994; IF/AIF: 0,126; Q4 (2020, InCites JCR SSCI)] [CiteScore: 0,70; SNIP: 0,253; SJR: 0,189; Q1</p>

		<p>(2020, Scopus Sources)] [M.kr.: S 004] [Indėlis: 0,334]</p> <p>5. [S1; GB; OA] Stundziene, Alina; Sabonienė, Asta. Tangible investment and labour productivity: evidence from European manufacturing // Economic research–Ekonomiska istrazivanja. London : Routledge-Taylor & Francis. ISSN 1331-677X. eISSN 1848-9664. 2019, vol. 32, iss. 1, p. 3519-3537. DOI: 10.1080/1331677X.2019.1666024. [Social Sciences Citation Index (Web of Science); Scopus; DOAJ] [IF: 2,229; AIF: 2,219; IF/AIF: 1,004; Q2 (2019, InCites JCR SSCI)] [CiteScore: 2,30; SNIP: 1,174; SJR: 0,490; Q2 (2019, Scopus Sources)] [M.kr.: S 004] [Indėlis: 0,500]</p> <p>6. [S1; PL; OA] Startiene, Grazina; Dumciuviene, Daiva; Stundziene, Alina; Januskevicius, Andrius. An impact of the euro adoption on the international trade of new EMU members: the Lithuanian case // Entrepreneurial business and economics review. Kraków : Cracow University of Economics. ISSN 2353-883X. eISSN 2353-8821. 2019, vol. 7, iss. 1, p. 201-215. DOI: 10.15678/EBER.2019.070111. [Emerging Sources Citation Index (Web of Science); Scopus] [CiteScore: 1,90; SNIP: 0,866; SJR: 0,401; Q2 (2019, Scopus Sources)] [M.kr.: S 004] [Indėlis: 0,250]</p> <p>7. [S1; NL] Stundžienė, Alina. Human welfare: can we trust what they say? // Journal of Happiness Studies. Dordrecht : Springer. ISSN 1389-4978. eISSN 1573-7780. 2019, Vol. 20, iss. 2, p. 579-604. DOI: 10.1007/s10902-018-9962-6. [Social Sciences Citation Index (Web of Science); Scopus] [IF: 2,335; AIF: 2,149; IF/AIF: 1,086; Q1 (2019, InCites JCR SSCI)] [CiteScore: 4,70; SNIP: 1,856; SJR: 1,193; Q1 (2019, Scopus Sources)] [M.kr.: S 004] [Indėlis: 1,000]</p> <p>8. [S1; CH; OA] Vojtovic, Sergej; Stundžienė, Alina; Kontautienė, Rima. The Impact of socio-economic indicators on sustainable consumption of domestic electricity in Lithuania // Sustainability. Basel : MDPI. ISSN 2071-1050. 2018, vol. 10, iss. 2, art. no. 162, p. 1-21. DOI: 10.3390/su10020162. [Social Sciences Citation Index (Web of Science); Scopus; DOAJ] [IF: 2,592; AIF: 3,032; IF/AIF: 0,854; Q2 (2018, InCites JCR SSCI)] [CiteScore: 3,01; SNIP: 1,206; SJR: 0,549; Q1 (2018, Scopus Sources)] [M.kr.: S 004] [Indėlis: 0,333]</p> <p>9. [S1; LT; OA] Pilinkiene, Vaida; Stundziene, Alina; Stankevicius, Evaldas; Grybauskas, Andrius. Impact of the economic stimulus</p>
--	--	---

		<p>measures on Lithuanian real estate market under the conditions of the COVID-19 pandemic // Inžinerinė ekonomika = Engineering economics. Kaunas : KTU. ISSN 1392-2785. eISSN 2029-5839. 2021, vol. 32, iss. 5, p. 459-468. DOI: 10.5755/j01.ee.32.5.28057. [Social Sciences Citation Index (Web of Science); Scopus; Business Source Complete] [IF: 1,292; AIF: 2,994; IF/AIF: 0,431; Q3 (2020, InCites JCR SSCI)] [CiteScore: 2,30; SNIP: 0,605; SJR: 0,303; Q2 (2020, Scopus Sources)] [M.kr.: S 004] [Indėlis: 0,250]</p> <p>10. [S1; LT; OA] Stundziene, Alina; Barkauskas, Vytautas; Giziene, Vilda. The leading indicators of the economic cycles in Lithuania // Inžinerinė ekonomika = Engineering economics. Kaunas : KTU. ISSN 1392-2785. eISSN 2029-5839. 2017, vol.28, iss.3, p. 280-289. DOI: 10.5755/j01.ee.28.3.16705. [Social Sciences Citation Index (Web of Science); Scopus; Business Source Complete] [IF: 0,709; AIF: 1,766; IF/AIF: 0,401; Q3 (2017, InCites JCR SSCI)] [CiteScore: 0,94; SNIP: 0,587; SJR: 0,341; Q2 (2017, Scopus Sources)] [M.kr.: S 004] [Indėlis: 0,334]</p>
--	--	--

Patvirtinta.