

Kursinis darbas "Lietuvos infliacijos modelis"

Daiva Kemzūraitė, Alma Mežanec, Laurynas Venčkauskas

2011 rugsėjo 21 diena

Planas:

1 Svarba:

identifikavus Lietuvos ekonomikoje taikytiną infliacijos modelį, galima tiksliau prognozuoti tolimesnę ekonomikos raidą bei siūlyti naudingesnius infliacijos kontrolės veiksmus.

2 Tyrimo objektas:

infliacija ir jos svyravimų priežasčių analizė Lietuvos ekonomikoje.

3 Tikslai:

- išsiaiškinti, nuo ko ir kaip priklauso infliacija; infliacijos priklausomybės tyrimas nuo konkrečių Lietuvos ekonomikos makroekonominių kintamųjų (infliacijos kontrolės priemonių).
- Lietuvos ekonomikos infliacijos modelis.
- infliacijos prognozė (prieš tai atrinkus modelį, kuris tiksliausiai paaiškina infliacijos svyravimus).
- ekonominė apžvalga - kiekvieno rezultato projekcija į ekonomiką.

4 Darbo struktūra;

4.1 Modelių, paaiškinančių infliacijos svyravimus užsienio šalių valstybėse, paieška;

4.1.1 Modelių analizė, tyrinėjimas: kiekvieno iš jų svarba, norint ištirti ekonominių svyravimų įtaką Lietuvos infliacijai;

4.1.2 Modelio pasirinkimas pagal Lietuvos ekonomikos vyksmų paaiškinamumą (įtaką) infliacijai bei kintamųjų faktinių duomenų prieinamumą;

4.2 Duomenų, reikalingų pasirinkto modelio realizacijai, paieška;

4.2.1 Duomenų analizė:

- duomenų apžvalga.
- grafikai.

4.2.2 Kiekvienos modelio komponentės stacionarumo tikrinimas;

4.3 Regresinių modelių kūrimas;

4.3.1 Ištirti Lietuvos ekonomikos infliacijos priklausomybę nuo modelyje naudojamų kintamųjų, sudarant tiesinę regresiją be ankstinių (toliau minima kaip (1r));

- Aptarti gautus rezultatus (koeficientų reikšmingumą, jų įverčius ir kitus regresinio modelio parametrus).
- (1r) regresijos įvertintų reikšmių ir faktinių infliacijos reikšmių grafikų brėžimas.

4.3.2 Ištirti Lietuvos ekonomikos infliacijos priklausomybę nuo modelyje naudojamų kintamųjų, sudarant vektorinę regresiją neįtraukiant ankstinių (toliau minima kaip (2r));

- Aptarti gautus rezultatus (koeficientų reikšmingumą, jų įverčius ir kitus regresinio modelio parametrus).
- (2r) regresijos įvertintų reikšmių ir faktinių infliacijos reikšmių grafikų brėžimas.
- (1r) ir (2r) infliacijos regresinių modelių palyginimas.

4.3.3 Ištirti Lietuvos ekonomikos infliacijos priklausomybę nuo modelyje naudojamų kintamųjų, sudarant tiesinę regresiją ir įtraukiant į ją ankstinius (toliau minima kaip (3r));

- Padirbėti su modeliu, išmetant iš modelio nereikšmingus narius (jeigu tokių yra), paliekant modelį, kurio visi koeficientai yra reikšmingi, t.y. papeda nuspėti infliaciją, ją paaiškina.

- Aptarti gautus rezultatus (koeficientų reikšmingumą, jų įverčius ir kitus regresinio modelio parametrus).
- (3r) regresijos įvertintų reikšmių ir faktinių infliacijos reikšmių grafikų brėžimas.
- (1r) , (2r) ir (3r) infliacijos regresinių modelių palyginimas.

4.3.4 Ištirti Lietuvos ekonomikos infliacijos priklausomybę nuo modelyje naudojamų kintamųjų, sudarant vektorinę regresiją ir įtraukiant į ją ankstinius (toliau minima kaip (4r));

- Palikti vektoriniame regresiniame modelyje (4r) tą ankstinių eilę, su kuria yra mažiausias AIC arba BIC kriterijus (pasirinktinai pagal situaciją).
- Aptarti gautus rezultatus (koeficientų reikšmingumą, jų įverčius ir kitus regresinio modelio parametrus).
- (4r) regresijos įvertintų reikšmių ir faktinių infliacijos reikšmių grafikų brėžimas.
- (1r) , (2r) , (3r) bei (4r) infliacijos regresinių modelių palyginimas (pagal faktines infliacijos reikšmes).

4.4 Remiantis atliktais keturiais regresiniais skaičiavimais, apibendrinti infliacijos priklausomumo nuo visų kintamųjų ypatybes bei padaryti ekonomines išvadas;

4.5 Infliacijos prognozė.

5 Literatūra (sąrašas nuolat pildomas):

5.1 www.stat.gov.lt;

5.2 www.lb.lt;

5.3 O. Blanchard „Makroekonomika“.

5.4 <http://epp.eurostat.ec.europa.eu/>