

Týždeň vedy 2014

# EKONOMETRICKÁ ANALÝZA EKONOMIKY SLOVENSKA

Ing. Alena Zámečníková

# ÚVOD

- členstvo SR v európskych štruktúrach
- dobiehanie vyspelejších krajín Európskej únie

# MODEL

- ekonometrické metódy - je možné špecifikovať model a následne identifikovať dlhodobý vývoj, ako i príčiny odchýlok v krátkodobom horizonte
- simulácie menovo-politických, fiškálnych, cenových alebo ponukových šokov, či už v rámci analýz týkajúcich sa výlučne domácej ekonomiky alebo analýz zameraných na celú eurozónu
- budúce smerovanie našej krajiny v rámci svetovej ekonomiky

# MODEL – ÚDAJOVÁ ZÁKLADŇA

- dostupnosť a kvalita dát, štrukturálne zmeny a neistoty týkajúce sa teoretickej štruktúry
- krátka história slovenskej ekonomiky a malý počet štrukturálnych zmien, ktorými od svojho vzniku prešla - sú dostupné makroekonomické dáta postačujúce pre analytické účely?

# MODEL - METODOLÓGIA

- viaceré metódy
- dynamické správanie premenných - použitie viacrozmerných modelov
- VAR modely - alternatíva k rozsiahlym makroekonomickým modelom
- ľahká dostupnosť a interpretovateľnosť výsledkov

# VAR(p)

- viacrovnicový model, v ktorom sú všetky premenné endogénne a každá z nich je vysvetľovaná zvyšnými premennými toho istého obdobia a o 1, 2 .. p období oneskorenými hodnotami všetkých premenných modelu.
- štrukturálny tvar modelu:

$$\Gamma y_t = \beta_0 + B_1 y_{t-1} + B_2 y_{t-2} + \dots + B_p y_{t-p} + u_t$$

# VAR

- štruktúralne vektorovo autoregresné modely
- kointegračné vektorovo autoregresné modely

# POUŽITÁ LITERATÚRA

- **JUSELIUS, K.:** *The Cointegrated VAR Model: Methodology and Applications (Advanced Texts in Econometrics)*, 2 ed. Oxford University Press, 2007
- **LIVERMORE, S. :** *An econometric Model of the Slovak Republic*. 2004.
- **LUKÁČIK, M. – LUKÁČIKOVÁ, A.:** *Vektorovo autoregresné modely a ich aplikácie v makroekonomickej analýze*. 1. vyd. Bratislava : Vydavateľstvo EKONÓM, 2013. 235 s. ISBN 978-80-225-3723-0

ĎAKUJEM ZA POZORNOST

10.11.2014

