

ACADEMIA DE STUDII ECONOMICE DIN BUCUREȘTI

Consiliul pentru Studii Universitare de Doctorat

Școala Doctorală de Finanțe



**METODE AVANSATE DE ESTIMARE A INDICATORILOR
MACROECONOMICI**

Dănuț-Georgian V. MIHAI

Conducător de doctorat: prof. univ. dr. Ștefan Daniel ARMEANU

București, Martie 2026

Lucrarea prezintă o serie de metode cantitative de analiză și prognoză a principalilor indicatori macroeconomici pe baza cărora se poate caracteriza economia României. De asemenea, s-a avut în vedere estimarea PIB-ului potențial, dar și a output gap-ului, utilizând 3 metode de estimare, respectiv metode univariate pe baza filtrelor Hodrick-Prescott și Band-Pass, abordarea utilizând funcția de producție și metoda multivariată folosind filtrul Kalman. Aspectele rezultate subliniază faptul că metoda multivariată are nivelul de precizie cel mai ridicat. Un alt aspect al lucrării, îl reprezintă studiul implicațiilor interacțiunii fiscal-monetare în economie prin implementarea metodologiei SVAR Bayesian, având drept obiectiv adoptarea politicilor publice eficiente. În plus, actualul studiu oferă un cadru de prognoză și investigare a principalelor șocuri, care au afectat economia României, utilizând un model Dynamic Stochastic General Equilibrium(DSGE), evidențiind comportamentul variabilelor în condiții de incertitudine ridicată. Nu în ultimul rând, în această lucrare s-a avut în vedere evaluarea datoriei publice și a deficitului bugetar, din perspectiva sustenabilității acestora. Pentru realizarea acesteia, s-a utilizat modelul Panel Smooth Transition Regression (PSTR) în urma căruia s-a constatat că factorii determinanți ai deficitului bugetar au un comportament diferit în funcție de variabila prag, respectiv nivelul economiei subterane.