

Instytut Ekonometrii

Uniwersytet Łódzki

Ramowy program szkolenia „Podstawy modeli DSGE”

dr hab. Paweł Baranowski

Sala T-004, godz. 9.00-15.30 (w tym przerwa 30 min.)

19 WRZEŚNIA 2016 (poniedziałek)

Podstawy teoretyczne (6h)

1. Modelowania DSGE a inne podejścia do makromodelowania.
2. Kiedy modele DSGE są przydatne, a kiedy nieprzydatne?
3. Podstawy teoretyczne: dynamiczny problem decyzyjny gospodarstw domowych.
4. Podstawy teoretyczne: dynamiczny problem decyzyjny przedsiębiorstw.
5. Podstawy teoretyczne: polityka banku centralnego.
6. Pełny model. Rozwiązanie racjonalnych oczekiwań, symulacje, odpowiedzi na impuls.

20 WRZEŚNIA 2016 (wtorek)

Praktyka DSGE w Dynare (6h)

1. Możliwości Dynare.
2. Podstawowy model w Dynare. Kalibracja parametrów.
3. Efekty zmiany kluczowych parametrów a odpowiedzi na impuls. Dyskusja wyników.
4. Rozszerzenia małego modelu DSGE: nawyki, indeksacja, wygładzanie stóp procentowych.
5. Wprowadzenie do estymacji DSGE. Przygotowanie danych.
6. Podsumowanie. Podstawowe informacje o modelach większej skali.