

mgr Anna Sulima

Instytut Matematyki Uniwersytetu Jagiellońskiego

Estymacja bayesowska modelu DSGE z rozkładem szoków t-Studenta

Przedstawione zostaną wyniki estymacji bayesowskiej dynamicznego, stochastycznego modelu równowagi ogólnej (DSGE) gospodarki Polski. Model DSGE opisuje równowagę gospodarstw domowych, przedsiębiorstw, banku centralnego i rządu. Ważnym elementem opisującym procesy gospodarcze w tym modelu są szoki strukturalne. W pracy odejdziemy od standardowego założenia, iż szoki te mają rozkład normalny, i pokażemy, że rozkład t-Studenta jest bardziej adekwatny do modelowania gospodarki Polski.