

SPRAWOZDANIE Z KONFERENCJI “40TH ANNIVERSARY MACROMODELS INTERNATIONAL CONFERENCE”

W dniach 21–24 października 2013 roku w Warszawie odbyła się czterdziesta, jubileuszowa międzynarodowa konferencja naukowa *Macromodels International Conference*. Konferencja, którą po raz pierwszy zorganizowano w 1974 roku, poświęcona jest modelowaniu ekonometrycznemu, w tym zwłaszcza modelowaniu gospodarek narodowych oraz prognozowaniu procesów gospodarczych. *Macromodels* ma nie tylko utrwaloną renomę w środowisku polskim, ale jest także dobrze znana zagranicą. Organizatorem konferencji jest zespół Katedry Modeli i Prognoz Ekonometrycznych Uniwersytetu Łódzkiego kierowanej przez prof. dr hab. Aleksandra Welfe oraz Komitet Statystyki i Ekonometrii Polskiej Akademii Nauk. Patronat honorowy nad 40-tą konferencją objął Prezes Narodowego Banku Polskiego. W obradach udział wzięło 77 uczestników, w tym 12 zaproszonych gości – najwyższej światowej klasy specjalistów z zakresu modelowania ekonometrycznego i ekonomii. Wśród zaproszonych profesorów znaleźli się: Karim Abadir, Badi Baltagi, Anindya Banerjee, Herman van Dijk, Stephen Hall, Søren Johansen, Katarina Juselius, Helmut Lütkepohl, Paul Mizen, Timo Teräsvirta, Martin Wagner oraz Peter Winker. Zorganizowano osiem sesji plenarnych, w ramach których 12 referatów wygłosili zaproszeni profesorowie oraz czternaście sesji równoległych, które objęły 41 wystąpień.

Konferencję otworzył profesor Aleksander Welfe, który przywitał wszystkich uczestników. Następnie, przemówienie wygłosił Prezes Narodowego Banku Polskiego – profesor Marek Belka, który przypomniał historię *Macromodels* i podkreślił znaczenie konferencji jako forum wymiany poglądów i nawiązywania kontaktów naukowych.

Referaty przedstawione w sesjach plenarnych dotyczyły najbardziej aktualnych i fundamentalnych problemów związanych z wnioskowaniem na podstawie szeregów czasowych i danych panelowych oraz zaawansowanych analiz empirycznych.

B. Baltagi (współautorzy: P. Egger i M. Kesin) zaproponował uogólnienie estymatora Hausmana-Taylora na przypadek przestrzennej korelacji składników losowych oraz zastosował go do estymacji parametrów funkcji produkcji dla przemysłu chemicznego w Chinach. H. Lütkepohl analizował identyfikację strukturalnych modeli wektorowej autoregresji na podstawie zmian wartości parametrów macierzy wariancji składników losowych zredukowanej postaci modelu. T. Teräsvirta (współautor: Y. Yang) omówił problemy związane ze specyfikacją, estymacją parametrów oraz

weryfikacją wektorowych autoregresyjnych modeli gładkiego przejścia. S. G. Hall (współautorzy: P. A. V. B. Swamy, G. S. Tavlás i G. Hondroyiannis) zaproponował uogólnioną definicję (nieliniowej) kointegracji zmiennych niestacjonarnych, które mogą nie być zintegrowane oraz metodę estymacji parametrów relacji kointegrujących. M. Wagner rozważył zastosowanie zmodyfikowanego estymatora metody najmniejszych kwadratów do regresji kointegrujących nieliniowych względem zmiennych $I(1)$ oraz analizy kointegracji zintegrowanych procesów lokalnie stacjonarnych. S. Johansen (współautorka: K. Juselius) wykazał asymptotyczną niezmienniczość wspólnych trendów stochastycznych zmiennych, które poddane zostały transformacjom liniowym. K. Abadir zaproponował nowe metody statystyczne, które pozwalają na udoskonalenie wyceny opcji oraz modelowania aktualnej i przyszłej struktury terminowej stóp procentowych, a także zmiennych takich jak m.in. kursy walutowe, czy indeksy giełdowe. A. Banerjee (współautorzy: M. Marcellino i I. Masten) wywodził z dynamicznego modelu czynnikowego dla niestacjonarnych zmiennych, model wektorowej korekty błędem rozszerzony o wspólne czynniki oraz omówił możliwości identyfikacji strukturalnej postaci tego modelu. P. Mizen (współautorzy: M. Bleaney i V. Veleanu) rozważył prognozowanie realnego tempa wzrostu gospodarczego za pomocą spreadów obligacji korporacyjnych dla Austrii, Belgii, Francji, Niemiec, Włoch, Holandii, Hiszpanii oraz Wielkiej Brytanii. P. Winker (współautorzy: H. Lütkepohl i A. Staszewska-Bystrova) zaprezentował bootstrapowe metody konstrukcji prognoz pasmowych oraz pasm ufności dla funkcji reakcji na impulsy dla modeli wektorowej autoregresji. H. van Dijk (współautorzy: M. Billio, R. Casarin, S. Grassi oraz F. Razazzolo) przedstawił metodę łączenia (kombinowania) wielowymiarowych rozkładów predykcyjnych wykorzystującą wagi, których wartości są zmienne w czasie. K. Juselius (współautor: M. Juselius) oszacowała na podstawie danych kwartalnych z lat 1990–2010 parametry krzywej Phillipsa wspartej oczekiwaniami dla Finlandii, dopuszczając możliwość wystąpienia dwóch reżimów.

Ożywione dyskusje wzbudziły także referaty wygłoszone w sesjach równoległych. Wystąpienia te dotyczyły: modelowania i prognozowania kursu walutowego (M. A. Dąbrowski i J. Wróblewska; R. Doman i M. Doman; W. Grabowski i A. Welfe; R. Kelm; M. Ca'Zorzi, J. Mućk i M. Rubaszek; V. Shevchuk), analizy cykli koniunkturalnych (W. Łuczyński; M. Osińska, T. Kufel, M. Błażejowski i P. Kufel; P. Piękoś; Ł. Lenart i M. Pipień; M. Skrzypczyńska), modelowania i prognozowania inflacji (K. Konopczak i A. Welfe; B. Mazur), analizy polityk gospodarczych (M. Kľúčik – polityka fiskalna; J. Boratyński i M. Zachłód-Jelec – polityka klimatyczna), testowania sezonowości (Ł. Lenart i M. Pipień), analizy kointegracji (E. Gosińska – testy stabilności; K. Łasak i C. Velasco – testy kointegracji ułamkowej; A. Pajor i J. Wróblewska – Bayesowski model VEC-SV; J. Wróblewska – Bayesowski model VEC-SF), modelowania powiązań i przepływów międzynarodowych (M. Humanicki, R. Kelm i K. Olszewski – inwestycje zagraniczne; E. Lechman – przepływy handlowe; Y. V. Vymyatnina – wspólna strefa ekonomiczna Rosji, Kazachstanu i Białorusi), ekonometrii finansowej (B. Będowska-Sójka; K. Bień-Barkowska;

Ł. Gątarek; R. Huptas; A. Kliber; J. Osiewalski i K. Osiewalski), modelowania sektora finansowego (V. Bystrov; M. Brzoza-Brzezina, M. Kolasa i K. Makarski; F. Schleer; K. Sum), analizy rynku pracy i płac (A. Chłoń-Domińczak i P. Strawiński; A. Parteka i J. Wolszczak-Derlacz), analizy input-output (J.-F. Emmenegger, H. Knolle i D. Chable), analizy danych strumieniowych (D. Kosiorowski i M. Snarska), modelowania oczekiwań (J. Acedański; R. Kruszewski), modelowania zagregowanej produkcji (K. Makiela) oraz metod wnioskowania statystycznego (K. Maciejowska).

Szczegółowy program konferencji oraz listę wszystkich jej uczestników znaleźć można na stronach internetowych konferencji: www.macromodels.uni.lodz.pl. Konferencja była dofinansowana ze środków Narodowego Banku Polskiego i Polskiej Akademii Nauk.

W roku 2014 *Macromodels International Conference* odbędzie się w dniach 17–20 listopada.

Anna Staszewska-Bystrova – Uniwersytet Łódzki

