

SYLABUS PRZEDMIOTU W SZKOLE DOKTORSKIEJ

Tytuł	<i>Ekonomia cyklu koniunkturalnego</i>
Tytuł w jęz. ang.	<i>Business cycle economics</i>

Status przedmiotu	obowiązkowy dla: <i>ogólny SzD</i>
	do wyboru dla:

Autor/autorzy sylabusa:	Zespół :	koordynator: dr hab. Michał Brzoza-Brzezina, prof. SGH
		członek zespołu: dr Michał Gradzewicz
		członek zespołu

Sygnatura przedmiotu:

Część A

1. Syntetyczna charakterystyka przedmiotu (główne hasła – około 400 znaków):

W pierwszej kolejności przedstawione zostaną najważniejsze metody wyodrębnienia danych cyklicznych, podstawowe cechy cyklu koniunkturalnego i metody datowania cykli. W dalszej kolejności zaprezentowane zostaną najważniejsze modele tłumaczące cykliczne wahania gospodarki: model RBC, model poszukiwań na rynku pracy, modele ze sztywnościami nominalnymi, modele z niedoskonałą informacją, modele niestabilności finansowej. Zajęcia prowadzone są częściowo w formie laboratorium komputerowego.

2. Słowa kluczowe (3 – 6 słów):

Wahania cykliczne, datowanie cyklu koniunkturalnego, model RBC

Część B

Przedmiotowe efekty uczenia się

Powiązanie z efektami uczenia się dla SzD

Wiedza (liczba efektów od 2 do 5)

W.1	Student zna podstawowe teorie wahań cyklicznych	P8S_WG
W.2	Student zna podstawowe cechy empiryczne wahań cyklicznych	P8S_WG

Umiejętności (liczba efektów od 2 do 5)

U.1	Student potrafi zmodyfikować model cyklu koniunkturalnego na	P8S_UW
-----	--	--------

	potrzeby badania wybranego zagadnienia	
U.2	Student rozumie role zmiennych, parametrów i szoków w modelu	P8S_UK
Kompetencje społeczne (liczba efektów od 1 do 3)		
K.1	Student zna zalety i wady współczesnych sposobów modelowania wahań cyklicznych	P8S_KK
K.2	Student rozumie społeczną odpowiedzialność władz monetarnych i fiskalnych za stabilizowanie cyklu koniunkturalnego	P8S_KR

Część C

Semestralny plan zajęć:

- 1 Analiza spektralna danych i ekstrakcja wahań cyklicznych (filtr HP, filtr CF, filtr Kalmana): wprowadzenie, oprogramowanie, praca z danymi
- 2 Badanie cyklicznych własności PKB, konsumpcji, inwestycji, inflacji, bezrobocia
- 3 Datowanie cykli koniunkturalnych
- 4 Wahania konsumpcji i inwestycji w ujęciu teoretycznym
- 5 Model realnego cyklu koniunkturalnego: wprowadzenie, oprogramowanie, kalibracja i estymacja
- 6 Cykliczne wahania na rynku pracy: model poszukiwań
- 7 Lepkie ceny, niedoskonała informacja i błędna koordynacja jako źródła wahań cyklicznych
- 8 Cykle finansowe i hipoteza Minsky'ego

Literatura podstawowa (jeśli wybrane fragmenty publikacji zwartych, to wskazane podanie rozdziałów, ew. stron):

1. McCandless, G. 2008, The ABCs of RBCs: An Introduction to Dynamic Macroeconomic Models, Harvard University Press
2. Hamilton, J.D., 1994 Time Series Analysis, Princeton University Press

Literatura uzupełniająca (jeśli wybrane fragmenty publikacji zwartych, to wskazane podanie rozdziałów, ew. stron):

1. Olivier J. Blanchard & Jean-Paul L'Huillier & Guido Lorenzoni, 2013. "News, Noise, and Fluctuations: An Empirical Exploration," American Economic Review, American Economic Association, vol. 103(7), pages 3045-3070
2. Brzoza-Brzezina, Michał & Makarski, Krzysztof & Wesołowski, Grzegorz, 2014. "Would it have paid to be in the eurozone?," Economic Modelling, Elsevier, vol. 41(C), pages 66-79.
3. Minsky Hyman 1982. "The financial-instability hypothesis: Capitalist processes and the behavior of the economy". Charles P. Kindleberger and Jean-Pierre Laffargue, Eds. Financial Crises: Theory,

History, and Policy. (2), 13–39.

4. Sargent, T.J., Dynamic Macroeconomic Theory, Harvard University Press

Część D

Forma zajęć:	Wymiar zajęć w godz.:
Ogółem godzin <i>w tym:</i>	30
wykład	15
laboratorium	15
Elementy oceny końcowej (ogółem 100%), w tym:	
Homework	50%
Final exam	50%
Liczba punktów ECTS	3,5

Część E

Metody dydaktyczne (nauczania) stosowane przez prowadzącego

M.1. wykład tradycyjny
M.5. laboratorium komputerowe
M.16. ćwiczenia z wykorzystaniem oprogramowania i sprzętu komputerowego

Część F

Metody weryfikacji (sprawdziany) osiągnięcia przedmiotowych efektów kształcenia

W.3. egzamin praktyczny
W.12. praca domowa

