

Bayesowskie modele VEC w analizie krótko- i długookresowych zależności wartości dodanej brutto wybranych gałęzi gospodarki polskiej

Celem pracy jest empiryczna analiza długo- i krótkookresowych zależności pomiędzy gałęziami gospodarki polskiej, wykonana na podstawie danych kwartalnych z lat 2002 – 2016. Do zbadania tego zagadnienia wykorzystano grupę bayesowskich modeli typu VEC z silnymi i słabymi (natychmiastowymi i opóźnionymi) czynnikami cyklicznymi. Liczbę wspólnych zależności oceniono na podstawie bayesowskiego porównywania modeli. Dodatkowo zbadano udział wstrząsów o charakterze trwałym i przejściowym w wyjaśnianiu wariacji błędu prognoz analizowanych wielkości.