

Robert Kruszewski
Szkoła Główna Handlowa
Katedra Matematyki i Ekonomii Matematycznej
E-mail: rkrusz@sgh.waw.pl

Modelowanie endogenicznych cykli koniunkturalnych

Głównym celem opracowania jest zbadanie wpływu prostego mechanizmu oczekiwań na dynamikę modelu cyklu koniunkturalnego, opartego na modelu Metzlera (1941). Pewien typ heterogenicznych oczekiwań częściowo racjonalnych przedsiębiorców został zastosowany w pracy *A Metzlerian business cycle model with nonlinear heterogeneous expectations* autorstwa Michaela Wegenera, Franka Westerhoffa i Georga Zaklana (Economic Modelling 26 (2009), 715–720). W pracy zaproponowana będzie nieliniowa funkcja, opisująca ewolucję zagregowanego strumienia konsumpcji, oraz uwzględnione zostaną inwestycje indukowane. Udowodnione zostanie twierdzenie o istnieniu równowag stacjonarnych. Podane zostaną warunki gwarantujące lokalną asymptotyczną stabilność tychże równowag. W badanym modelu zachodzi bifurkacja Neimarka-Sackera, w wyniku której pojawiają się atraktory okresowe i quasi-okresowe będące matematycznym modelem cyklu koniunkturalnego. Opisany zostanie wpływ zmiennych egzogenicznych na długość i amplitudę wahań produktu krajowego.