

Obsah

Předmluva	V
Obsah	VII
Podrobný obsah	XI
Seznam vybraných symbolů	XV
Kapitola 1 Úvod	1
Kapitola 2 Dynamické makroekonomické modely	3
2.1 Neoklasický versus nový keynesovský pohled	3
2.2 Škola nového keynesovství	4
2.3 Neoklasický pohled na makroekonomické modely určené pro politickou analýzu	5
2.4 Návrh modelu (model 2007)	10
2.5 Vstupní data a metoda odhadu (model 2007)	12
2.6 Výsledky odhadu (model 2007)	13
2.7 Analýza impulzní odezvy (model 2007)	17
2.8 Data a metoda odhadu (model 2009)	22
2.9 Výsledky odhadu (model 2009)	22
2.10 Analýza impulzní odezvy (model 2009)	22
2.11 Shrnutí	26
2.12 Literatura	27
Kapitola 3 Makroekonometrické strukturální modelování dlouhodobých vztahů české ekonomiky	31
3.1 Současný stav makroekonometrického modelování dlouhodobých ekonomických vztahů	32
3.2 Ekonomické odvození základního modelu	41

3.3	Metodika VECMX	45
3.4	Formulace a odhad dlouhodobého strukturálního modelu české ekonomiky (VECM)	50
3.5	Analýza a ekonomická interpretace finálního odhadnutého kointegračního VECM s restrikcemi	77
3.6	Shrnutí.....	86
3.7	Literatura	88
Kapitola 4 Modelování vybraných problémů konkurenceschopnosti regionů ekonomik zemí EU		93
4.1	Zkoumání regionální konkurenceschopnosti vybraných ekonomik EU	93
4.2	Alternativní přístupy k hodnocení regionální konkurenceschopnosti vybraných ekonomik EU	110
4.3	Aplikace alternativních přístupů k hodnocení regionální konkurenceschopnosti vybraných ekonomik EU	139
4.4	Shrnutí.....	171
4.5	Literatura	172
Kapitola 5 Analýza a modelování konvergence vybraných ekonomik a regionů EU		179
5.1	Teoretické a ekonomické vymezení reálné konvergence se zaměřením na regionální aspekty	179
5.2	Analýza reálné konvergence prostřednictvím ekonometrického modelu a jeho aplikace na regiony vybraných zemí EU	197
5.3	Panelová konvergence regionů V4.....	201
5.4	Shrnutí.....	205
5.5	Literatura.....	205
Kapitola 6 Vývoj cen aktiv v makroekonomických modelech.....		211
6.1	Ekonomické souvislosti vývoje cen aktiv	211
6.2	Identifikace bublin cen aktiv – průřez nástroji	213
6.3	Příčiny bublin – modelové typy bublin	218
6.4	Dynamika cen aktiv a bublin v makroekonomických modelech.....	222

6.5	Implikace makroekonomického modelování cen aktiv pro hospodářskou politiku	231
6.6	Shrnutí.....	232
6.7	Literatura.....	233
	Kapitola 7 Závěr	237
	Přílohy	241
	Literatura	255
	Rejstřík.....	273
	Summary	277

Podrobný obsah

Předmluva	V
Obsah	VII
Podrobný obsah	XI
Seznam vybraných symbolů	XV
Kapitola 1 Úvod	1
Kapitola 2 Dynamické makroekonomické modely	3
2.1 Neoklasický versus nový keynesovský pohled.....	3
2.1.1 Škola reálných hospodářských cyklů.....	3
2.2 Škola nového keynesovství.....	4
2.3 Neoklasický pohled na makroekonomické modely určené pro politickou analýzu.....	5
2.3.1 Nový keynesovský přístup k politické analýze.....	7
2.4 Návrh modelu (model 2007).....	10
2.5 Vstupní data a metoda odhadu (model 2007).....	12
2.6 Výsledky odhadu (model 2007).....	13
2.7 Analýza impulzní odezvy (model 2007).....	17
2.8 Data a metoda odhadu (model 2009).....	22
2.9 Výsledky odhadu (model 2009).....	22
2.10 Analýza impulzní odezvy (model 2009).....	22
2.11 Shrnutí	26
2.12 Literatura	27
Kapitola 3 Makroekonometrické strukturální modelování dlouhodobých vztahů české ekonomiky	31
3.1 Současný stav makroekonometrického modelování dlouhodobých ekonomických vztahů	32
3.2 Ekonomické odvození základního modelu	41
3.3 Metodika VECMX	45
3.3.1 Rozšířený VARX model.....	45
3.3.2 Kointegrační VAR model	46
3.3.3 Metody kointegrační analýzy	49
3.4 Formulace a odhad dlouhodobého strukturálního modelu české ekonomiky (VECM).....	50
3.4.1 Datové soubory a jejich analýza	50

3.4.2	Popis a odhad strukturálního modelu české ekonomiky	63
3.5	Analýza a ekonomická interpretace finálního odhadnutého kointegračního VECM s restrikcemi	77
3.6	Shrnutí	86
3.7	Literatura	88

Kapitola 4 Modelování vybraných problémů konkurenceschopnosti regionů ekonomik zemí EU

4.1	Zkoumání regionální konkurenceschopnosti vybraných ekonomik EU.....	93
4.1.1	Teoretická východiska konkurenceschopnosti se zaměřením na regionální aspekty.....	93
4.1.2	Hodnocení ekonomické konkurenceschopnosti.....	102
4.1.3	Datová základna pro hodnocení regionální konkurenceschopnosti.....	107
4.2	Alternativní přístupy k hodnocení regionální konkurenceschopnosti vybraných ekonomik EU.....	110
4.2.1	Specifické ekonomické koeficienty efektivity.....	110
4.2.2	Strukturální ukazatele Evropské unie	116
4.2.3	Ekonometrický model panelových dat	121
4.2.4	Vícekritériální přístupy k hodnocení regionální konkurenceschopnosti	124
4.3	Aplikace alternativních přístupů k hodnocení regionální konkurenceschopnosti vybraných ekonomik EU.....	139
4.3.1	Aplikace vybraných specifických koeficientů pro hodnocení regionální konkurenceschopnosti zemí V4.....	140
4.3.2	Aplikace soustavy strukturálních ukazatelů EU pro hodnocení regionální konkurenceschopnosti zemí V4.....	144
4.3.3	Aplikace ekonometrického modelu panelových dat pro hodnocení regionální konkurenceschopnosti zemí V4.....	151
4.3.4	Aplikace vícekritériálních přístupů pro hodnocení regionální konkurenceschopnosti zemí V4.....	158
4.3.5	Porovnání a analýza výsledků	168
4.4	Shrnutí	171
4.5	Literatura	172

Kapitola 5 Analýza a modelování konvergence vybraných ekonomik a regionů EU

5.1	Teoretické a ekonomické vymezení reálné konvergence se zaměřením na regionální aspekty	179
5.1.1	Teoreticko-metodologická východiska konvergence.....	180
5.1.2	Typologie konvergence	184
5.1.3	Možnosti měření reálné konvergence v podmínkách ekonomik a regionů EU.....	191
5.2	Analýza reálné konvergence prostřednictvím ekonometrického modelu a jeho aplikace na regiony vybraných zemí EU.....	197
5.2.1	Koncept nelineárního regresního modelu reálné konvergence	197

5.2.2	Aplikace nelineárního regresního modelu pro hodnocení beta konvergence regionů zemí V4.....	200
5.3	Panelová konvergence regionů V4	201
5.3.1	Koncept víceroznicového panelového modelu.....	202
5.3.2	Aplikace ekonometrického modelu panelových dat pro hodnocení beta konvergence regionů zemí V4	202
5.3.3	Porovnání a analýza výsledků	204
5.4	Shrnutí	205
5.5	Literatura	205
Kapitola 6 Vývoj cen aktiv v makroekonomických modelech.....		211
6.1	Ekonomické souvislosti vývoje cen aktiv.....	211
6.2	Identifikace bublin cen aktiv – průřez nástroji	213
6.2.1	Problém stanovení fundamentální hodnoty aktiva.....	214
6.2.2	Poměrové ukazatele	215
6.2.3	Trendové křivky a statistické filtry	216
6.2.4	Specifikační testy.....	217
6.2.5	Test jednotkového kořene a kointegrace.....	217
6.2.6	Test založený na délce trvání (Duration dependence test).....	218
6.3	Příčiny bublin – modelové typy bublin.....	218
6.3.1	Modely racionálních investorů s identickými informacemi.....	219
6.3.2	Modely racionálních investorů s asymetrickými informacemi	220
6.3.3	Modely s limitovanou arbitráží.....	220
6.3.4	Modely s heterogenními názory investorů ohledně fundamentální hodnoty aktiva	221
6.4	Dynamika cen aktiv a bubliny v makroekonomických modelech	222
6.4.1	Gruen, Plumb a Stone (2005)	222
6.4.2	Filardo (2004).....	225
6.4.3	Ventura (2002) a Martin a Ventura (2010).....	227
6.4.4	DSGE modely a ceny aktiv – Iacoviello (2005) a Iacoviello a Neri (2010).....	230
6.5	Implikace makroekonomického modelování cen aktiv pro hospodářskou politiku.....	231
6.6	Shrnutí	232
6.7	Literatura	233
Kapitola 7 Závěr		237
Přílohy		241
Literatura		255
Rejstřík		273
Summary		277