

Helsingin yliopisto - Helsingfors universitet - University of Helsinki ID 2003-2471

Tiedekunta-Fakultet-Faculty Valtiotieteellinen tiedekunta		Laitos-Institution-Department Kansantaloustieteen laitos	
Tekijä-Författare-Author Jokinen, Jani-Pekka			
Työn nimi-Arbetets titel-Title Tavanomainen makromalli vai sektorimalleista aggregoitu makromalli? Osittaminen talouden mallintamisessa			
Oppiaine-Läroämne-Subject Kansantaloustiede			
Työn laji-Arbetets art-Level Pro gradu	Aika-Datum-Month and year 2003-11-10	Sivumäärä-Sidantal-Number of pages 49	
<p>Tiivistelmä-Referat-Abstract</p> <p>Tutkielmassa tarkastellaan osittamista talouden mallintamisessa. Aihealuetta lähestytään tutkimuskysymyksellä: Kuinka informaatio tarkasteltavasta taloudellisesta ilmiöstä lisääntyy, kun sitä tarkastellaan sektoreihin jaettuna. Tutkielmassa asetetaan vertailuun sektorimalleista aggregoitu makromalli ja tavanomainen makromalli, jossa ilmiötä tarkastellaan pelkästään kokonaistaloudellisten muuttujien tasolla. Tarkastelu rajataan yhden yhtälön regressiomalleihin eli sektoreita mallinnetaan yhden yhtälön ositespesifeillä dynaamisilla regressiomalleilla. Sektorimalleista aggregoitu makromalli on myös yhden yhtälön dynaaminen regressiomalli samoin kuin vertailtava tavanomainen makromalli.</p> <p>Osittamistamista tarkastellaan tilanteessa, jossa käytettävissä on äärellinen määrä luokittelumuuttujia, joissa on äärellinen määrä luokkia ja jokainen osite on määriteltävissä luokittelun, ristiintaulukoinnin ja solujen yhdistelyn avulla. Osituksen optimaalisuuskeriteeriksi valitaan sektorimalleista aggregoidun makromallin selitysaste. Ositukselle asetetaan useita perusteltuja ehtoja, jotka estävät ajautumasta tulkinallisiin tai metodologisiin ongelmiin tutkimusongelman ratkaisussa.</p> <p>Vertailtavissa malleissa mallinnetaan log-muutoksia, joilla on monia hyödyllisiä ominaisuuksia tavallisiin suhteellisiin muutoksiin verrattuna. Sektorimallien aggregoinnissa log-muutoksille konsistentisti aggregoitava painorakenne on Vartia I:n mukainen. Aggregoinnin peruslauseesta johdetaan yleisemmissä tilanteissa toimiva aggregointilause eli yleistetty aggregoinnin peruslause, joka toimii myös Vartia I:n mukaiselle painorakenteelle sektorimalleja aggregoitaessa.</p> <p>Tutkielmassa osoitetaan, että sektorimalleista aggregoidulla makromallilla (SAM-mallilla) saadaan tarkempi kuva tarkasteltavasta ilmiöstä, koska SAM-malli huomioi johdonmukaisesti sektorien erilaisuuden, jolloin SAM-mallin selitysaste on korkeampi käytettäessä samaa aineistoa kuin tavanomaisessa makromallissa. Lopuksi pohditaan SAM-mallinnuksen mahdollisuuksia parantaa mikrotalousteorian hyödyntämistä makrotaloustieteessä.</p> <p>Tutkielmassa käytetyt tärkeimmät lähteet ovat: Spanos, A.(1986): Statistical foundation of econometric modelling ja Vartia, Y. (1979): Kvadraattisten mikroyhtälöiden aggregoinnista.</p>			
Avainsanat-Nyckelord-Keywords aggregointi makromalli sektorimalli osittaminen makrotaloustiede			
Säilytyspaikka-Förvaringsställe-Where deposited			
Muita tietoja-Övriga uppgifter-Additional information			