



SYLABUS PRZEDMIOTU

Informator	2016/2017	
Tytuł oferty	Test koniunktury jako podstawa krótkookresowych prognoz gospodarczych	
Sygnatura	237560 - 0949	3 pkt. ECTS
Prowadzący	dr Sławomir Dudek oraz zespół: prof. dr hab. Elżbieta Adamowicz, dr Konrad Walczyk	

A. Cel przedmiotu

Zrozumienie i zapoznanie się z metodami wykorzystania i ze sposobami interpretacji wyników otrzymywanych w badaniach metodą testu koniunktury do analiz makroekonomicznych. W szczególności: Zapoznanie się z zasadami metodologicznymi testu koniunktury (jakie obejmuje obszary i sektory gospodarki, zasady konstrukcji pytań i ankiet koniunktury, zasady agregacji i ważenia wyników jednostkowych, zasady konstrukcji prostych i złożonych wskaźników koniunktury; sposoby prezentacji wyników) i jego cechami specyficznymi, które odróżniają test od innych badań ankietowych. W szczególności prezentacja zharmonizowanej metodologii testu koniunktury w Unii Europejskiej oraz rekomendacji OECD. Przegląd badań podobnych do testu koniunktury, np. Purchasing Managers Index (PMI). Zrozumienie przesłanek teoretycznych stosowania wyników testu koniunktury w analizach wahań aktywności gospodarczej. Zrozumienie zalet i wad testu koniunktury. Prezentacja obszarów zastosowań wyników testu koniunktury. Przegląd testów koniunktury w Polsce i wybranych krajach Unii Europejskiej. Prezentacja i przegląd metod badawczych służących (wraz z przykładami zastosowań empirycznych) formalnej identyfikacji i określeniu związków pomiędzy wynikami otrzymywanymi w badaniach metodą testu koniunktury, a danymi ze statystyki ilościowej, w szczególności metod wykorzystywanych do sporządzania krótkookresowych prognoz gospodarczych. M.in. probabilistyczna i regresyjna metoda kwantyfikacji danych jakościowych, złożony model regresyjny (model łącznikowy, ang. bridge model).

B. Program przedmiotu

Tematyka wykładu obejmuje: charakterystykę, znaczenie i historię rozwoju testu koniunktury jako metody badawczej, teoretyczne stosowanie tej metody w analizach wahań koniunkturalnych, metodologię testu koniunktury, metody i narzędzia wykorzystania testu koniunktury do sporządzania krótkookresowych prognoz gospodarczych (ilustrowane przykładami empirycznymi).

C. Szczegółowe przedmiotowe efekty kształcenia

Wiedza	<ol style="list-style-type: none">1. Znać zasady metodologiczne testu koniunktury (w szczególności zharmonizowaną metodologię testu koniunktury w Unii Europejskiej).2. Posiadać wiedzę nt. przesłanek teoretycznych stosowania wyników testu koniunktury w analizach wahań aktywności gospodarczej.3. Znać metody kwantyfikacji danych jakościowych.4. Znać metody prognozowania na podstawie wyników testu koniunktury.
Umiejętności	<ol style="list-style-type: none">1. Umiejętność interpretacji jakościowych wskaźników koniunktury.2. Umiejętność sporządzania prognoz krótkookresowych wskaźników makroekonomicznych na podstawie wyników testu koniunktury.3. Rozeznanie źródeł pozyskiwania i zakresu przedmiotowego wskaźników koniunktury dla Polski i krajów UE.4. Umiejętność kwantyfikacji danych jakościowych.
Kompetencje społeczne	Student powinien rozumieć i umieć czytać teksty ekonomiczne poświęcone wykorzystaniu wyników z testu koniunktury.

D. Semestralny plan zajęć

- 1 Historia i rozwój testu koniunktury; definicja i ogólny opis testu koniunktury; ośrodki prowadzące test koniunktury w Polsce i UE; wyniki bieżących badań; znaczenie testu koniunktury.
- 2 Metodologia testu koniunktury 1: zasady konstrukcji pytań i ankiet koniunktury (zharmonizowana ankieta UE); zasady doboru próby; zasady agregacji i ważenia wyników jednostkowych.
- 3 Metodologia testu koniunktury 2: sposoby prezentacji wyników; zasady konstrukcji prostych i złożonych wskaźników koniunktury; zasady konstrukcji barometrów koniunktury.
- 4 Test koniunktury w różnych obszarach gospodarki: test konsumencki, w przemyśle, budownictwie, handlu, usługach, rolnictwie, badanie inwestycji - podobieństwa i różnice.
- 5 Dekompozycja wskaźników koniunktury na trend, wahania sezonowe i czynniki czysto losowe (addytywna i multiplikatywna).
- 6 Wahania aktywności gospodarczej a wyniki testu koniunktury: zrozumienie przesłanek teoretycznych stosowania wyników testu koniunktury w analizach wahań aktywności gospodarczej; zalety i wady testu koniunktury; obszary zastosowań wyników testu koniunktury.
- 7 Analiza relacji danych jakościowych z ilościowymi - wybrane metody i narzędzia; przegląd metod i zastosowań empirycznych.
- 8 Metody kwantyfikacji danych jakościowych: metoda probabilistyczna; metoda regresyjna.
- 9 Krótkookresowe prognozowanie gospodarcze; definicja prognozy; prognoza krótkookresowa: "forecasting" vs "nowcasting"; metody prognozowania (przegląd); weryfikacja trafności prognozy.
- 10 Złożony model regresyjny (model łącznikowy, ang. "bridge model"); inne metody kwantyfikacji danych jakościowych.
- 11 Krótkookresowe prognozy indeksu produkcji przemysłowej w Polsce i konsumpcji prywatnej przy wykorzystaniu wyników badania koniunktury IRG SGH.
- 12 Kryzys finansowy 2007-2009 w świetle wyników testu koniunktury.
- 13 Synchronizacja wahań koniunkturalnych w krajach UE w świetle wyników testu koniunktury.
- 14 Metody zbliżone do testu koniunktury - PMI (purchasing manager index), Barometr Consumer Finance.
- 15 Metody wykorzystania wyników testu koniunktury na poziomie jednostkowym.

E. Literatura podstawowa (obowiązkowe podręczniki)

1. Dudek S. (2006), Krótkookresowe prognozowanie działalności gospodarczej przedsiębiorstw przemysłowych na podstawie testu koniunktury, rozprawa doktorska, maszynopis, IRG SGH; 2. Adamowicz E. (2008), Badania koniunktury gospodarczej i ich skuteczność, Zeszyty Naukowe AE Poznań nr 37, ss 88-97, EA; 3. OECD (2003) Business Tendency Surveys - A Handbook; 4. European Commission DG ECFIN (2007), Joint Harmonised EU Programme of Business and Consumer Surveys - User Guide; 5. European Commission DG ECFIN (2006), The Joint Harmonised EU Programme of Business and Consumer Surveys, Belgium. Special Report No 5/2006; 6. Bieć M. (1996), Test koniunktury - metody, techniki, doświadczenia, Prace i Materiały Instytutu Rozwoju Gospodarczego -Zeszyt nr 48, Szkoła Główna Handlowa, Warszawa; 7. Adamowicz E., Dudek S., Pachucki D., Walczyk K. (2009), Synchronizacja cyklu koniunkturalnego polskiej gospodarki z krajami strefy Euro w kontekście struktury tych gospodarek, w: Raport na temat pełnego uczestnictwa Rzeczypospolitej Polskiej w trzecim etapie Unii Gospodarczej i Walutowej -Projekty badawcze Część I, Narodowy Bank Polski; 8. Adamowicz E., Dudek S., Pachucki D., Walczyk K. (2010), Financial crisis and its effects on real economies in the light of quantitative and survey data, referat, 30th CIRET Conference, New York, October 2010.

F. Literatura uzupełniająca

1. OECD (1997), Cyclical Indicators and Business Tendency Surveys; 2. OECD (2005), Handbook on Constructing Composite Indicators: Methodology and User Guide; 3. Tomczyk E. (2004), Racjonalność oczekiwań. Metody i analiza danych jakościowych, Monografie i Opracowania nr 529, Szkoła Główna Handlowa; 4. Barczyk R., Gaca A., Zagoździńska I (1994), Badanie koniunktury, Zeszyty Metodyczne i Klasyfikacje, GUS, Warszawa; 5. Barczyk R., Kowalczyk Z. (1993), Metody badania koniunktury gospodarczej, PWN, Warszawa; 6. Zasoby portalu OECD: Business Tendency and Consumer Surveys: International Development Work and Co ordination; http://www.oecd.org/document/22/0,3343,en_2649_34353_32159254_1_1_1_1,00.html; 7. Zasoby portalu CIRET: CIRET - Centre for International Research on Economic Tendency Surveys; <http://www.ciret.org/>; 8. Driver C., Urga G. (2004), Transforming Qualitative Survey Data: Performance Comparisons for the UK, Oxford Bulletin of Economics & Statistics; Vol. 66 Issue 1, p. 71-89; 9. Pesaran M.H. (1984), Expectations Formations and Macroeconometric Modelling, w: Malgrange P. i Muet P.A. (red.) Contemporary Macroeconomic Modelling, Basil Blackwell, Oxford; 10. Smith J., McAleer M. (1995), Alternative Procedures for Converting Qualitative Response Data to Quantitative Expectations: An Application to Australian Manufacturing, Journal of Applied Econometrics 10, p. 165-185.

G. Najważniejsze publikacje autora(ów) dotyczące proponowanych zajęć

1. Dudek S. (2008), Consumer Survey Data and short-term forecasting of households consumption expenditures in Poland, MPRA Paper, University Library of Munich, Germany; 2. Białowolski P., Dudek S. (2008), Wzorce formułowania ocen i prognoz przez polskie gospodarstwa domowe - fakty i mity, w: Koniunktura gospodarcza - 20 lat doświadczeń Instytutu Rozwoju Gospodarczego SGH, red. Adamowicz E., Prace i Materiały Instytutu Rozwoju Gospodarczego, Zeszyt 80, SGH, Warszawa 2008; 3. Adamowicz E., Dudek S., Walczyk K. [2006], Regional business activity in a light of business surveys results, w: Survey Data in Economic Research, red. Klimkowska J., Prace i Materiały Instytutu Rozwoju Gospodarczego, Zeszyt 79, SGH, Warszawa 2008; 4. Dudek S. (2007), Krótkookresowe prognozowanie produkcji sprzedanej przemysłu przetwórczego na podstawie wyników testu koniunktury, Prace i Materiały Wydziału Zarządzania Uniwersytetu Gdańskiego, 5/2007, s. 125-146; 5. Białowolski P., Dudek S. (2005), Wykorzystanie wyników badania kondycji gospodarstw domowych IRG SGH do analizy i prognozowania spożycia indywidualnego gospodarstw domowych, w: Z badań koniunktury gospodarczej w Polsce, red. Adamowicz E., Prace i Materiały Instytutu Rozwoju Gospodarczego, Zeszyt 76, SGH, Warszawa 2005, s. 7-18; 6. Białowolski P., Dudek S., Kowalczyk B. (2005), Analiza zwrotności w badaniach konsumenckich oraz próby poprawiania reprezentatywności na przykładzie badania kondycji gospodarstw domowych IRG SGH, w: Z badań koniunktury gospodarczej w Polsce, red. Adamowicz E., Prace i Materiały Instytutu Rozwoju Gospodarczego, Zeszyt 76, SGH, Warszawa 2005, s. 19-28; 7. Adamowicz E., Dudek S., Walczyk K. (2005), The Usefulness of Business Surveys Data for Short-term Forecasting - Raw Data vs Seasonally Adjusted and Smoothed One, w: Economic Tendency Surveys and Cyclical Indicators, red. Adamowicz E., Klimkowska J., Prace i Materiały Instytutu Rozwoju Gospodarczego, Zeszyt 75, SGH, Warszawa 2005, s. 77-97; 8. Adamowicz E., Dudek S., Walczyk K. (2006), Wykorzystanie danych z badania koniunktury w przemyśle przetwórczym do prognozowania rozwoju gospodarki w: Diagnozowanie i prognozowanie koniunktury gospodarczej w Polsce, red. Mocek M., Akademia Ekonomiczna w Poznaniu, Katedra Badań Marketingowych, Poznań; 9. Adamowicz E., Dudek S., Walczyk K. (2005), The Usefulness of Business Surveys Data for Short-term Forecasting - Raw Data vs Seasonally Adjusted and Smoothed One, Statistics in Transition, Volume 7, Number 2, s. 199-219; 10. Dudek S., Walczyk K. (2004), Business Climate Indicators to Predict Economic Activity, w: Composite Indicators of Business Activity for Macroeconomic Analysis, red. Matkowski Z., Prace i Materiały Instytutu Rozwoju Gospodarczego, Zeszyt 74, SGH, Warszawa 2004, s. 283-298; 11. Adamowicz E., Dudek S., Walczyk K. (2004), The Use of Survey Data in Macroeconomic Analysis, w: Composite Indicators of Business Activity for Macroeconomic Analysis, red. Matkowski Z., Prace i Materiały Instytutu Rozwoju Gospodarczego, Zeszyt 74, SGH, Warszawa 2004, s. 357-376; 12. Adamowicz E., Dudek S., Walczyk K. (2002), Wykorzystanie wyników testu koniunktury do prognoz krótkoterminowych, w: Diagnozy i prognozy stanu gospodarki w świetle badań koniunktury, Prace i Materiały Instytutu Rozwoju Gospodarczego - Zeszyt 73, s. 7-39, Szkoła Główna Handlowa, Warszawa; 13. Dudek S. (2002), Krótkookresowe mierniki sytuacji gospodarczej (wady i zalety) a użyteczność wyników testu koniunktury, Zeszyty Naukowe Kolegium Gospodarki Światowej, Zeszyt 12, s. 101-118, SGH, Warszawa.

H. Sygnatury wymaganych prerekwizytów

nie są wymagane

I. Wymiar i forma zajęć

	Stacj.	Sob. niedz.	Popołud.
Ogółem:	30	14	30
Wykład	15	7	15
Konwersatorium	5	2	5
Ćwiczenia	10	5	10

J. Elementy oceny końcowej

egzamin testowy	60%
referat	40%

K. Wymagana znajomość języka obcego

nie jest wymagana

L. Kryteria selekcji

M. Metody prowadzenia zajęć

referaty
dyskusje