

Spis treści

Wstęp	7
--------------------	---

Rozdział 1. Koncepcja ograniczonej racjonalności w modelach formułowania oczekiwań inflacyjnych 13 |

1.1. Hipoteza racjonalnych oczekiwań i jej krytyka	16
1.2. Koncepcja ograniczonej racjonalności Herberta A. Simona	24
1.3. Wybrane modele formułowania oczekiwań odbiegające od hipotezy racjonalnych oczekiwań	27
1.3.1. Adaptacyjne uczenie się	27
1.3.2. Lepka informacja i model epidemiologiczny	31
1.3.3. Racjonalna nieuwaga	34
1.4. Heterogeniczność oczekiwań	37
Podsumowanie	41

Rozdział 2. Schematy adaptacyjnego uczenia się i ich empiryczna weryfikacja – przegląd literatury 45 |

2.1. Przykład modelu jednorównaniowego w warunkach adaptacyjnego uczenia się	45
2.2. Podstawowe algorytmy adaptacyjnego uczenia się	49
2.2.1. Metoda najmniejszych kwadratów a metoda stochastycznego gradientu	50
2.2.2. Malejący parametr wzmocnienia a stały parametr wzmocnienia ...	51
2.3. Adaptacyjne uczenie się ze stałym parametrem wzmocnienia	54
2.3.1. Przesłanki wyboru algorytmu ze stałym parametrem wzmocnienia ..	54
2.3.2. Implikacje założenia o stałym parametrze wzmocnienia	56
2.4. Empiryczna weryfikacja modelu adaptacyjnego uczenia się	58
Podsumowanie	61

Rozdział 3. Analiza procesu formułowania oczekiwań inflacyjnych konsumentów	63
3.1. Opis danych i metoda kwantyfikacji danych ankietowych na temat oczekiwań inflacyjnych	64
3.2. Test na występowanie adaptacyjnego uczenia się	70
3.2.1. Opis weryfikowanych modeli adaptacyjnego uczenia się	71
3.2.2. Test na występowanie procesów adaptacyjnego uczenia się	74
3.3. Porównanie różnych modeli adaptacyjnego uczenia się	83
Podsumowanie	90
Aneks 3.1. Kształtowanie się skwantyfikowanych miar oczekiwań inflacyjnych konsumentów na tle inflacji bieżącej	93
Rozdział 4. Szybkość uczenia się	100
4.1. Porównanie szybkości uczenia się w różnych krajach	101
4.2. Zmiany parametru wzmocnienia w czasie	107
4.3. Analiza czynników wpływających na szybkość uczenia się	116
Podsumowanie	123
Aneks 4.1. Oszacowania modelu dla okresów trzyletnich	124
Zakończenie	125
Bibliografia	129
Wykaz skrótów	138
Spis tabel	139
Spis wykresów	141