

TURUN KAUPPAKORKEAKOULU  
Taloustieteen laitos

HÄMÄLÄINEN, JOSE: Pitkän aikavälin ennustemalli Suomen taloudelle

Pro gradu -tutkielma, 62 s.

Taloustiede

Marraskuu 2010

-----

Makrotaloudellinen malli on joukko tilastoista estimoituja yhtälöitä ja identiteettejä. Yhtälöt koostuvat endogeenisistä, mallin sisällä määräytyvistä ja eksogeenisistä, mallin ulkopuolella määräytyvistä muuttujista. Mallien avulla pyritään ennustamaan talouden kehitystä ja arvioimaan poliittisten muutosten vaikutusta talouteen. Ensimmäisen makrotaloudellisen mallin kehitti 1930-luvulla Nobel-palkittu Jan Tinbergen.

Mallit jaetaan usein perinteisiin makroekonometrisiin malleihin ja yleisen tasapainon malleihin. Perinteiset makroekonometriset mallit ovat kysyntävetoisia ja niiden koko vaihtelee paljon: malli voi koostua kymmenestä tai tuhansista yhtälöistä. Tyypillinen esimerkki perinteisestä makroekonometrisestä mallista on Suomen pankin BOF3-malli. Yleisen tasapainon malleista ennustetyössä käytetään lähinnä DSGE-malleja. Ne ovat mikroperustaisia makrotaloudellisia malleja ja pääsääntöisesti yhtälömäärältään suuria. Makroekonometriset mallit koostuvat pääosin estimoiduista yhtälöistä ja identiteeteistä, mutta DSGE-malleissa käytetään myös kalibroituja yhtälöitä. Pitkän aikavälin mallit sisältävät ominaisuuksia sekä perinteisistä makroekonometrisistä malleista että DSGE-malleista. Niillä pyritään ennakoimaan talouden kehitystä vuosikymmenien päähän.

Makromalleja on myös kritisoitu jonkin verran. Erityisesti Lucas-kritiikki on vaikuttanut mallien kehitykseen. Keskustelua on käyty myös tilastollisten menetelmien käytöstä, talusteorian oppien huomioimisesta ja mallien optimaalisesta koosta. Oleellista on, että mallia käytetään suunniteltuun käyttötarkoitukseen.

F-LMM-malli on pitkän aikavälin ennustemalli Suomen taloudelle. Malli on kehityksensä alkuvaiheessa ja sisältää 32 yhtälöä. Perustana mallille on itävaltalainen A-LMM-malli. F-LMM-malli on tarjontapainotteinen, eli yritysten käyttäytymisen mallintaminen on ratkaisevassa asemassa tasapainon määräytymisen kannalta. Mallia voidaan käyttää esimerkiksi demografisten muutosten tai tuottavuuden kehityksen vaikutusten arviointiin.

Asiasanat: mallintaminen, makrotaloudelliset mallit, ennustemallit