



Michał Bernardelli, Mariusz Próchniak, Bartosz Witkowski

Szkoła Główna Handlowa w Warszawie

mbernard@sgh.waw.pl, mproch@sgh.waw.pl, bwitko@sgh.waw.pl

Analiza konwergencji cyklicznej i dochodowej w krajach UE z wykorzystaniem ukrytych modeli Markowa

Zgodnie z hipotezą konwergencji kraje słabiej rozwinięte rozwijają się szybciej niż kraje wyżej rozwinięte i dzięki temu zbliżają się do nich stopniowo pod względem poziomu rozwoju. W literaturze istnieje wiele definicji realnej konwergencji gospodarczej oraz wiele metod wykorzystywanych przy badaniu tego zjawiska.

W artykule przedstawiono propozycję badania realnej konwergencji opartej na zastosowaniu ukrytych modeli Markowa oraz ścieżek Viterbiego. Skoncentrowano się przy tym na analizie konwergencji cyklicznej i dochodowej dla 28 krajów Unii Europejskiej w okresie 1995-2016. Badanie obejmowało identyfikację punktów zwrotnych w szeregach związanych z 12 zmiennymi makroekonomicznymi dla panelu państw UE. Uwzględniono przy tym siłę gospodarek poszczególnych państw w postaci wag przy uśrednianiu stanów łańcuchów ukrytych modeli Markowa. Wyniki pokazują m.in. realną zbieżność Polski do pozostałych krajów UE w kategoriach poziomów PKB per capita wg PSN oraz stóp wzrostu PKB, z krótkookresowym krótkim okresem dywergencji podczas kryzysu globalnego.