

Współcześnie jednym z ważnych elementów określających mechanizmy zależności gospodarczych w skali makro są globalne rynki finansowe. Ich rola nieustannie wzrasta zaś charakter oddziaływań na koniunkturę uległ w ostatniej dekadzie zasadniczej zmianie. Z tego względu kwestia badania mechanizmów zależności pomiędzy zmiennymi pochodzącymi z rynków finansowych ma zasadnicze znaczenie praktyczne i poznawcze. Celem projektu jest wypracowanie metod badania zależności na rynkach finansowych które są wolne od pewnych uproszczeń obecnych w standardowym instrumentarium badań empirycznych.

Ważnym elementem jest dopuszczenie bardziej złożonej postaci zależności pomiędzy badanymi wielkościami. Jest prawdopodobne, że pozwoli to na ujawnienie nowych własności mechanizmów funkcjonowania rynków finansowych i natury ich współzależności.

Wypracowanie lepszych narzędzi badawczych pozwoli uzyskać bardziej wiarygodne wyniki w kwestiach takich jak badanie mechanizmów rozprzestrzeniania się kryzysów a także oceny tzw. ryzyka systemowego. Może to pozwolić m.in. na wypracowanie bardziej skutecznych metod oceny ryzyka a także strategii zabezpieczenia przed ryzykiem przenoszonym poprzez rynki finansowe. Monitorowanie poziomu ryzyka jest m. in. elementem polityki makroostabilnościowej (makroostrożnościowej), zaś lepsze zarządzanie ryzykiem przyczynia się do większego bezpieczeństwa podmiotów gospodarczych zaangażowanych na rynkach finansowych.

Dodatkowo, badanie rynków finansowych z wykorzystaniem bardziej zaawansowanych narzędzi może dostarczyć jakościowo nowych wyników empirycznych. Wyniki takie mogą stymulować dalszy rozwój teorii rynków finansowych, co przyczyni się do lepszego zrozumienia ich roli oraz mechanizmów funkcjonowania.