

<<动态随机一般均衡模型及其应用>>

图书基本信息

书名：<<动态随机一般均衡模型及其应用>>

13位ISBN编号：9787504956132

10位ISBN编号：7504956139

出版时间：2010-10

出版时间：中国金融

作者：刘斌

页数：321

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问：<http://www.tushu007.com>

<<动态随机一般均衡模型及其应用>>

内容概要

鉴于DSGE模型的重要性，本书将系统地介绍DSGE模型的开发和应用，将分别从DSGE模型的结构、模型的求解和模拟、模型中参数的确定、模型的比较和选择以及最优经济政策的选择等几个方面详细介绍DSGE模型开发与应用的技术细节，并且在最后一章我们将基于我国的实际数据探讨DSGE模型针对不同经济问题的运用。

据笔者现在了解的信息，国内外目前还没有一部专著全面和细致地介绍DSGE模型的开发和应用，因而笔者期望本书能使读者了解DSGE模型开发和应用的最新进展。

本书可供不同层次的计量经济学习者使用，可供从事经济分析和预测的人员参考，特别是可作为研究生进行计量经济学学习的教材及参考书。

<<动态随机一般均衡模型及其应用>>

作者简介

刘斌

重庆大学经济与工商管理学院博士、教授、博士生导师，厦门大学会计发展研究中心博士后，重庆大学经济与工商管理学院会计学系主任，重庆市会计学科学术带头人，中国会计学会会员，中国注册会计师协会非执业会员，重庆市会计学会常务理事，重庆市审计学会副会长，重庆市会计电算化协会副会长，重庆市司法鉴定委员会司法会计鉴定专家，重庆市企业信息化专家组成员；主持国家自然科学基金项目1项，作为主研参与国家自然科学基金项目4项，主持省部级课题5项，大型企业集团咨询项目10项；出版专著教材13部，发表论文40余篇；主要研究领域：财务会计、企业信息化。

<<动态随机一般均衡模型及其应用>>

书籍目录

第一章 DSGE模型的基本介绍 第一节 一个简单的DSGE模型 第二节 传统计量经济模型与Lucas批判
第三节 两种建模方式的比较 第四节 DSGE模型建模的一般步骤第二章 DSGE模型的结构 第一节 微观经济主体的行为刻画 一、动态优化的一些方法 二、一些典型经济主体的行为刻画 第二节 从微观行为方程到宏观行为方程 一、同质性经济主体的加总方法 二、异质性经济主体的加总方法 第三节 DSGE模型的整体结构特性 一、稳态特性 二、动态特性第三章 DSGE模型的求解与模拟 第一节 DSGE模型求解前的预处理 一、在模型平稳的情况下如何去掉实际数据的趋势项 二、如何将模型转换成平稳的形式 三、如何将非线性模型转换成线性模型 第二节 带有预期变量模型的基本解法 一、预期及终值条件 二、线性情况 三、非线性情况 第三节 模型求解结果与实际数据之间的对应 第四节 模拟与情景分析 一、模拟的种类 二、模拟的应用第四章 DSGE模型中参数的确定及模型的选择和选择 第一节 利用卡尔曼滤波处理不可观测的变量 第二节 模型的识别 第三节 参数的确定方法 一、校准 二、GMM 三、SMM 四、极大似然估计方法 五、Bayes估计方法 第四节 模型的选择与选择 一、传统的计量经济学模型比较与选择方法 二、Bayes模型选择和比较方法第五章 DsGE模型与最优经济政策的选择 第一节 社会福利函数及对社会福利函数的二阶近似 第二节 目标函数、目标变量、操作工具 第三节 政策决策方式与最优政策的选择 一、时间不一致性 二、几种决策方式下的最优政策选择 三、决策方式对经济的影响——静态偏差与动态偏差 第四节 政策规则的稳健性第六章 DSGE模型在我国的应用 第一节 一个封闭经济的DSGE模型 第二节 一个开放经济的DSGE模型在货币政策分析中的应用 一、DSGE模型在中央银行开发和应用方面的基本概况 二、我国DSGE模型的结构 三、模型中货币政策的传导机制 四、DSGE模型的求解及参数的校准和估计 五、模型的应用 第三节 一个OLG形式的DSGE模型在物价水平的财政决定理论中的应用 一、物价水平研究的基本概况 二、物价水平的财政决定理论 三、国外关于物价水平的财政决定理论的实证研究 四、物价水平的财政决定理论对货币政策选择的影响 五、对我国实证研究采用的模型 六、对我国的实证研究结果 七、结论和建议 第四节 不确定环境下最优财政政策规则的选择 一、损失函数的形式及财政政策的决策方式 二、不同财政政策决策方式对经济动态特性的影响 三、不同财政政策决策方式对社会福利的影响 四、财政政策规则应用的可行性参考文献

版权说明

本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问:<http://www.tushu007.com>