

<<中国经济波动特征>>

图书基本信息

书名：<<中国经济波动特征>>

13位ISBN编号：9787564504397

10位ISBN编号：7564504390

出版时间：2012-9

出版时间：刘方 郑州大学出版社 (2012-09出版)

作者：刘方

页数：199

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>

<<中国经济波动特征>>

内容概要

《中国经济波动特征（1978-2009）与政策研究：基于实际经济周期理论》主要内容分为三篇。上篇是关于实际经济周期（RBC）模型求解技术问题的介绍（第二、三、四章），这一部分详细讨论了如何利用RBC模型研究宏观经济波动问题及相关技术问题。中篇是做文献梳理和中国数据准备的工作（第五、六章），该部分主要进行文献综述及中国经济波动特征事实的描述。下篇是利用RBC模型讨论中国经济（1978—2009）波动的相关问题（第七、八、九章），该部分检验标准RBC模型对中国经济波动特征事实的解释力，构造融入中国经济运行特点的RBC模型并进行动态模拟；在以中国1978—2009年宏观经济数据校准的RBC模型基础上，考察政府政策冲击的影响。本书不仅可以作为经济学研究生学习高级宏观经济学的课外读物，同时也是一本跟踪宏观经济学前沿和中国经济学工作者研究主流经济学的参考资料。

<<中国经济波动特征>>

作者简介

刘方，男，河南鄆城人，1977年生。

经济学博士，河南财经政法大学经济学院副教授。

主要研究领域是中国经济波动问题。

2006年以来陆续在《经济学研究》、《宏观经济研究》、《经济经纬》、《统计与决策》等国内知名杂志发表多篇学术论文。

<<中国经济波动特征>>

书籍目录

上篇 第一章绪论 第一节研究背景 第二节研究框架 第三节主要结论 第四节主要贡献及进一步研究的方向 第二章趋势与波动的分解 第一节统计学方法 一、回归法 二、BN分解 三、UC分解 四、Hamihon状态转换分解 第二节经济学方法 一、BQ分解 二、KPSW分解 第三节统计学与经济学的混合分解 一、HP滤波法 二、ES滤波法 三、BP滤波法 第三章实际经济周期(RBC)模型的估计方法 第一节极大似然(ML)方法 一、卡尔曼滤波 二、似然函数 三、似然估计在RBC模型中的应用 四、两个例子 第二节广义矩(GMM)方法 一、广义矩(GMM)方法的原理 二、利用GMM方法估计单一冲击的RBC模型 三、多冲击的RBC模型的GMM估计 第三节校准方法 一、模型环境 二、校准程序 三、求解模型 四、模型模拟 第四节贝叶斯方法 一、贝叶斯定理 二、贝叶斯估计的原理 三、贝叶斯估计的一个简单例子 四、贝叶斯估计在RBC模型估计中的应用 第四章RBC模型的计算与Matlab 第一节Dynare工具箱 一、界定模型冲击是否随机 二、垄断竞争下的RBC模型 三、Dvnare程序的编写 四、完整DyDare程序的样板 第二节Uhlig工具箱 一、对数线性化 二、Uhlig方法——待定系数法 三、Uhlig方法中的Matlab程序 四、存在劳动市场的模型处理 中篇 第五章RBC理论文献综述 第一节早期经典Rbc文献述评 一、Rbc研究的开山之作：《资本建设周期与总量波动》 二、Long和Plosser(1983)的早期多部门RBC模型 三、早期RBC理论的经典综述(King、Plosser和Rebelo, 1988) 四、小结 第二节扩展的Rbc模型述评 一、改进早期RBC模型 二、引入新的冲击源 三、建立多重均衡模型 四、融合凯恩斯主义内容 五、研究国际经济波动 第三节几个重要的扩展RBC模型介绍 一、劳动不可分模型简介 二、要素窖藏(Factor Hoarding)模型简介 三、货币先行模型简介 第四节新兴市场国家RBC文献述评 一、经济制度变革的影响 二、流动性约束的影响 三、政府政策的影响 四、其他因素的影响 第五节国内RBC文献述评 第六节小结 第六章中国经济波动事实 第一节数据说明 一、实际资本数据 二、实际投资数据 三、实际消费数据 四、实际产出及其他数据 第二节1978—2009年的中国经济波动事实 一、H—P滤波器 二、中国1978—2009年经济波动特征事实 三、特征事实比较分析 第三节1952—2009年的中国经济波动事实 一、1952—2009年中国经济波动事实表 二、波动事实比较分析 本章附录 下篇 第七章标准RBC模型的解释力 第一节标准可分劳动RBC模型的解释力 一、模型 二、求解模型 三、参数校准 四、模拟结果及评价 第二节标准不可分劳动RBC模型的解释力 一、不可分劳动与可分劳动的区别 二、模型的最优条件 三、模拟结果及评价 第三节政府购买冲击的影响 一、政府购买的引入 二、模拟结果及评价 本章附录 第八章资本窖藏及流动性约束的影响 第一节资本窖藏模型 一、模型 二、模型的求解 三、参数校准 四、模拟结果及评价 第二节劳动可变下的资本窖藏模型 一、模型 二、模型的求解与校准 三、模拟结果及评价 第三节融入政府购买冲击的资本窖藏模型 一、模拟结果及评价 二、部分参数的灵敏度分析 三、结论 第四节流动性约束模型 一、模型 二、模型的求解与校准 三、模拟结果及评价 第五节消费冲击模型 一、模型 二、参数校准 三、模型结果 四、结论 第六节小结 本章附录 第九章RBC框架下的外生政府政策分析 第一节不同税制下政府购买变动效应分析 一、模型 二、模拟结果评价 三、各变量的最优反应方程 四、政策冲击分析 五、结论 第二节外生货币发行规则变动影响分析 一、模型 二、模型求解 三、模拟结果评价 四、货币规则影响分析 五、结论 本章附录

<<中国经济波动特征>>

章节摘录

版权页：插图：第二节扩展的RBC模型述评 RBC模型的拓展不仅局限于克服早期模型的不足，而且在新的方向上取得了很大进展，特别在引入新冲击源，建立多重均衡模型，研究国际经济波动，融合凯恩斯主义内容等方面成果显著。

一、改进早期RBC模型 20世纪80年代RBC理论在解释美国经济波动方面取得了很大成功，当然也遇到了一些问题。

经济学家针对存在的问题，在标准RBC模型的基础上引入新的因素，通过构造标准RBC模型的扩展模型，使得Kin9和Rebelo（1999）提到的问题大部分得到解决或取得共识。

Greenwood、Hercowitz和Huffman（1988）通过引入资本的可变设备利用率降低了对大的劳动跨期替代弹性的依赖。

不过，为了拟合劳动市场的波动特征。

即使不依赖大的劳动供给跨期替代弹性，也需要大的劳动供给期内替代弹性支持。

经济学家通过两条途径使这一问题得到合理解释。

一是Ch0和Rogerson（1988）以及Cho和Cooley（1994）引入家庭的异质性，即每个家庭对工作价值评价不一致，不同的家庭在相同的情况下作出的劳动选择不同。

二是Han。

en（1985）以及Rogersen（1988）引入家庭选择的非凸性，即要么就业要么失业。

这两条途径都加大了劳动市场替代弹性。

真实工资强顺周期性的消除可通过引入劳动合同得到解决，相关文献有Danthine和Donaldson（1995），Gomme和Greenwood（1995），Boldrin和Horvath（1995）。

股票升水问题通过在两部门模型的基础上引入存在习惯形成的效用函数得到部分解决，相关文献的作者有Boldrin Christiano和Fishe（1995），Christiao和Fisher（1995）等。

经济学家通过引入要素窖藏行为或投入要素的可变利用率，使技术冲击高估问题基本得到解决，相关作者有的文献包括：Greenwood、Hercowitz和Huffman（1988），Burnside、Eichenbaum和Rebelo（1993），Cho和Bils（1994），Burnside和Eichenbaum（1996）。

二、引入新的冲击源 早期的RBC模型把技术冲击看成经济波动的唯一源泉。

后续研究以此为基础，考虑其他波动源的作用，取得了丰硕的成果。

第一，能源冲击。

研究表明石油和其他能源价格的波动与美国经济的波动有一定的联系。

Kim和Loungani（1992），Rotemberg和Woodford（1996），Kvdland（2000）在RBC框架下研究能源价格冲击的作用，发现能源价格冲击的引入改善了标准RBC模型的解释力，但该类冲击不足以作为经济波动的主要根源。

第二，财政政策冲击。

在RBC模型中引入政府购买冲击，可以考察不同税收政策对经济波动的影响。

Christiano和Eichenbaum（1992），Baxter和King（1993），Braun（1994）以及McGrattan（1994）的研究发现引入财政政策冲击，在改善了消费和劳动时间的波动模拟效果的同时，降低了劳动时间与平均劳动生产力之间的相关系数，而且提高了产出的波动幅度，使得模型的整体解释力较标准模型有了较大提高。

第三，货币冲击。

Cooley和Hansen（1995）认为货币冲击对经济波动产生的重要影响有两种解释，一是卢卡斯的货币幻觉说，二是存在价格或工资刚性。

通过不同模型的模拟结果的对比分析，发现货币冲击只有与价格或工资刚性相结合的时候才会产生重大影响。

Dotsey、King和Wolman（1999），Clarida、Gali和Gertler（1999），Smets和Wouters（2003）在存在名义刚性的前提下研究了货币冲击的影响。

在这些模型中技术冲击仍扮演相当重要的角色，货币冲击可以提升模型的解释力，但不能像货币主义

<<中国经济波动特征>>

者倡导的那样单独引起经济波动。

三、建立多重均衡模型 在标准RBC模型中引入诸如外部性、规模报酬递增或垄断竞争等因素，就可能使模型存在多重均衡。

这类模型的诱人之处在于不依赖外生冲击，仅靠经济主体信念的变化就可导致经济波动，也就是说当经济主体对经济运行比较悲观时，认为目前经济正逐步进入萧条，那么经济运行就真的陷入低谷。

另外，多重均衡模型具备内在的持续性（persistent），不必像标准RBC模型那样，必须依赖外来冲击的强持续性来产生持续性较强的宏观时间序列。

相关文献有wen（1998a），Benhabib和Wen（2003），Jaimovich（2004b）。

这类模型的弱点在于要求经济主体拥有协调一致的易变信念。

<<中国经济波动特征>>

编辑推荐

《中国经济波动特征(1978-2009)与政策研究:基于实际经济周期理论》不仅可以作为经济学研究生学习高级宏观经济学的课外读物,同时也是一本跟踪宏观经济学前沿和中国经济学工作者研究主流经济学的参考资料。

<<中国经济波动特征>>

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>