

动态经济学方法



[动态经济学方法_下载链接1](#)

著者:龚六堂

出版者:北京大学出版社

出版时间:2002-7

装帧:

isbn:9787301196335

《动态经济学方法(第2版)》主要内容简介：动态经济学方法对于一个立志进行经济学、金融学研究的人来讲是至关重要的，国外很多著名大学的经济学系、商学院都要为研究生开设这方面的课程。《动态经济学方法(第2版)》系统地介绍了动态经济学的方法

。以使读者对动态经济学方法有一个更深的了解，让读者熟知动态经济学方法的应用。

《动态经济学方法(第2版)》由三部分构成。考虑到动态经济学模型更多地以离散时间模型的形式出现，我们将离散时间问题的处理方法放在了第一部分：将连续时间问题的处理方法放在了第二部分；考虑到读者对一些基础知识，如凸集合和凸函数以及Lagrange方法已经比较熟悉了，我们把这部分内容作为预备知识放在了第三部分。

《动态经济学方法(第2版)》给出了大量的经济学模型，如Ramsey模型、Sidrauski模型、OLG模型、投资模型等，这些都是经济学中非常重要的、基本的模型。我们还给出了一些数值计算方法以及经济学应用方面的例子，如在第二章给出了动态经济学问题中经常用到的Kalman滤波方法；在第七章作为离散时间方法的应用，给出了离散选择问题；在第十一章给出了连续时间数值方法、有限差分方法、微扰法以及投影法。考虑到计算机的大量应用，并且大量的经济学问题不能通过解析方法得到解析解，我们在书中也适当兼顾了Matlab的应用，给出了计算程序。

《动态经济学方法(第2版)》可以作为高年级本科生和研究生的优化方法、数理经济学和动态经济学方法等课程的教材，也可以作为研究动态经济学的参考书。

作者介绍:

龚六堂，北京大学光华管理学院应用经济学系主任，教授、博士生导师，国家杰出青年基金获得者，2004年入选教育部首届“新世纪优秀人才”。

主要研究领域为宏观经济管理、公共财政、动态经济学以及中国经济等。在国际主流经济学刊物和《经济研究》、《中国社会科学》、《管理世界》等国内重要刊物上发表论文近百篇。研究成果先后获得教育部“科学技术进步奖”三等奖；北京市人文社会科学优秀成果一等奖、二等奖；第九届霍英东基金会全国高校青年教师奖(研究类)一等奖；第四届中国人文社会科学优秀成果三等奖。主持教育部人文社会科学“十五”规划项目、国家社会科学基金、国家自然科学基金委面上项目、国家自然科学基金委杰出青年基金项目以及香港研究基金会项目等。

苗建军，美国波士顿大学经济系副教授。1992年6月毕业于中国科技大学，获数学学士学位；1995年6月获中山大学经济学硕士学位；1998年6月获加拿大皇后大学金融学硕士学位；2003年5月获美国罗彻斯特大学经济学博士学位。

研究领域集中在金融与宏观经济学以及它们之间的交互机制与决策理论，此外还涉及产业组织理论、公共财政等领域。研究成果集中于投融资决策及公司动态、不完全市场中的动态一般均衡模型、资产定价和市场微观结构等方面，并在非标准的偏好理论的应用方面进行了探索性研究。在American Economic Journal: Macroeconomics, Economic Theory, Journal of Economic Theory, Journal of Financial Economics, Journal of Finance等国际权威杂志上公开发表学术论文多篇。

同时为美国经济学会、美国金融学会及计量经济学会成员。

目录: 第一部分 离散时间情形第一章 确定性下的差分方程 第一节 一维一阶线性差分方程 第二节 一维二阶线性差分方程 第三节 高维一阶线性差分方程组 第四节 非线性动态系统 习题第二章 随机线性差分方程 第一节 一阶随机线性差分方程组 第二节 线性理性预期模型 第三节 Kalman滤波 习题第三章 确定性下的动态规划 第一节 压缩映射的不动点性质 第二节 最优化原理 第三节 值函数的性质 第四节 动态特征 习题第四章 不确定性下的动态规划 第一节 最优化原理 第二节 值函数的性质 第三节 Euler方程 习题第五章 线性二次规划 第一节

确定性下的线性二次规划问题 第二节 随机线性二次规划问题 第三节 线性二次逼近问题
习题第六章 数值方法 第一节 介绍 第二节 动态规划的常用算法 第三节
求解Bellman方程的例子 附录 Matlab程序 习题第七章 应用 第一节
离散时间的Ramsey模型 第二节 投资储蓄问题 第三节 消费理论 第四节 资产定价理论
第五节 Stockman模型 第六节 离散选择问题 习题 第二部分 连续时间情形第八章
微分方程动力系统 第一节 可求解的微分方程 第二节 微分方程的稳定性 习题第九章
确定性下的最优控制和动态规划 第一节 自由端点问题 第二节 固定边界问题 第三节
各种终点受约束情形 第四节 比较静态分析 第五节 带代数约束的控制问题 第六节
确定性的动态规划方法 习题第十章 最优控制原理的应用 第一节 Ramsey模型 第二节
国外经济援助的作用 第三节 政府公共开支对经济的影响 第四节 效用函数中的财富
第五节 投资理论 习题第十一章 连续时间数值方法 第一节 有限差分法 第二节 微扰法
第三节 投影法 习题第十二章 不确定性的动态规划方法 第一节 Ito公式 第二节
不确定性问题的动态规划方法 习题第十三章 连续时间动态规划方法的应用 第一节
Merton模型 第二节 不确定性下的投资理论 第三节 随机增长模型 第四节
政府公共开支的增长与波动的影响 第五节 行使选择权问题 习题 第三部分
数学附录第十四章 凸集合和凸函数 第一节 凸集合 第二节 凸函数 第三节
Benveniste和Scheinkman定理 习题第十五章 线性规划与非线性规划问是 第一节
线性规划 第二节 非线性规划 第三节 应用 习题第十六章 度量空间和赋范向量空间
第一节 基本概念 第二节 对应及极大值定理 习题第十七章 测度理论和积分 第一节
测度空间 第二节 可测函数和积分 第三节 乘积空间和单调类定理 第四节 条件期望
习题第十八章 Markov过程及其收敛性 第一节 基本概念 第二节 离散空间上的Markov链
第三节 一般空间上的Markov过程和转移函数 第四节 收敛性与稳定分布参考文献
· · · · · (收起)

[动态经济学方法_下载链接1](#)

标签

经济学

最优化方法

金融

宏观

动态经济学

光华应经

金融数学

评论

有不少公式错误到第三版还没改过来，估计是助教偷懒了

参考，似乎第一版更全面一点，还有习题解答

..... 真心不能给面子啊太混乱不说还到处弄错>

感兴趣的可以去这本书底下看评论，如果真是翻译，那真是...

复习一遍泛函的感觉，证明基本略过了，读过林元烈的应用随机过程和用炯明楼卫红的简明最优化其他人的泛函测度论。所以不愿细读证明过程，只看定理引理和例子和习题。所以读的很快，囫圇吞枣不求甚解。不过这本书写的跟数学书一样，只需要有数学基础就够了。我现在相信网上八卦数学博士出生的田国强七天就读通了mascollel并通过考试，似乎是邹恒甫的八卦。如果经济学搞成比拼数学功底就失去了经济学的本源。我是读一个2015西班牙裔名字的高频研究者写的一本高频交易的专业书才读这个，因为里面有不少动态规划的内容，而我一直半桶水没学这个动态规划，拿这本书补一补。

印刷或计算太多，而且，步骤之间的衔接不太紧密，有的跳跃较大，不易理解，比起蒋中一的《动态最优化基础》差远了。

[动态经济学方法 下载链接1](#)

书评

[动态经济学方法_下载链接1_](#)