

经济世界的不确定性



[经济世界的不确定性_下载链接1](#)

著者:Lars Peter Hansen

出版者:电子工业出版社

出版时间:2017-1-1

装帧:其他

isbn:9787121305528

《经济世界的不确定性》内容简介：本书由拉尔斯·彼得·汉森（Lars Peter Hansen）和托马斯·萨金特（Thomas J. Sargent）所著，两位作者分别于2013年和2011年获得诺贝尔经济学奖。作者在书中将稳健性控制理论应用于经济学和金融学当中。该书中的稳健性控制允许经济决策者质疑其模型并采取预防性决策以防止模型误设的不良后果，从而扩展了理性预期模型。该特征对于理解风险价格而言意义重大。此外，书中的内容还讨论了如何对决策者的模型误设担忧进行校准并量化分析。

作者介绍:

拉尔斯·彼得·汉森（Lars Peter Hansen），芝加哥大学教授，国际著名经济学家（宏观经济学和动态经济学）。他因为对“资产定价理论的杰出贡献”而被授予2013年度诺贝尔经济学奖。他是美国国家科学院和美国金融学会的会员，且是世界计量经济学会前任主席。汉森教授的著作研究了经济决策者在不确定性下的行为及其动态模型，他的主要贡献在于设计了与经济模型的概率结构相一致的计量经济学方法，并将该方法应用于消费、储蓄和资产定价理论。

托马斯·萨金特（Thomas J. Sargent），纽约大学经济学教授。由于其对“宏观经济学中因果分析的实证研究”而被授予2011年度诺贝尔经济学奖。他目前是美国国家科学院、世界计量经济学会的会员，并曾任美国经济学会、世界计量经济学会以及动态经济学会的主席。在诺贝尔奖颁奖典礼上，萨金特教授将自己的工作形容为使用经济学和统计学来理解市场和政府如何改进人们的福利。

关于译者：汪川，经济学博士、博士后，现为中国社会科学院财经战略研究院副研究员，主要研究方向为宏观经济学。汪川博士长期跟踪分析宏观经济和金融形势，主持国家自然科学基金和国家部委多项课题，参与国家社科基金重大项目、国家自然科学基金应急项目以及中国社会科学院院创新工程项目；在核心期刊发表论文数十篇，多次获得中国社会科学院优秀信息对策奖和优秀论文奖。

目录: 第1章 概论

1.1 有关模型不确定性的问题

1.2 有关模型不确定性的十篇论文

第2章 线性指数二次高斯贴现控制

2.1 成本公式

2.2 成本递归函数和综合函数

2.3 无限期下的成本

2.4 时不变的线性控制过程

2.5 对于无限期贴现问题的求解

2.6 结束语

第3章 稳健的持久收入和定价

3.1 引言

3.2 递归风险敏感性控制

3.3 稳健持久收入理论

3.4 估计

3.5 资产定价

3.6 从市场风险价格中量化稳健性

3.7 跨期平均风险权衡

3.8 结束语

附录

第4章 模型设定、稳健性、风险价格和模型检测的四个半群

4.1 导论

- 4.2 概述
- 4.3 数学预备知识
- 4.4 对四个半群的研究
- 4.5 模型误设及稳健性控制
- 4.6 投资组合分配
- 4.7 风险要求权定价
- 4.8 统计性判别
- 4.9 熵与不确定性市场价格
- 4.10 结束语

附录

第5章 稳健控制和模型不确定性

- 5.1 引言
- 5.2 基准资源分配问题
- 5.3 模型误设
- 5.4 双稳健控制问题
- 5.5 乘积公式的递归性
- 5.6 两个偏好排序
- 5.7 偏好次序的递归性
- 5.8 结束语

第6章 稳健控制和模型误设

- 6.1 引言
- 6.2 概述
- 6.3 三个普通控制问题
- 6.4 对于模型误设的担忧
- 6.5 概率测度集合上的双稳健控制问题
- 6.6 固定概率空间上的博弈
- 6.7 序贯时间规则下的惩罚性问题
- 6.8 序贯时间规则下的约束设定
- 6.9 递归多元先验分布
- 6.10 结束语

附录

第7章 置疑或波动性

- 7.1 概述
- 7.2 股票溢价和无风险利率之谜
- 7.3 选择设定
- 7.4 类型1主体: Kreps - Porteus - Epstein - Zin - Tallarini
- 7.5 高风险厌恶的类型1主体经济
- 7.6 重新阐释
- 7.7 重新阐释Tallarini
- 7.8 消除不确定性的福利收益
- 7.9 贝叶斯方法和学习
- 7.10 结束语

附录

第8章 稳健性估计和无承诺控制

- 8.1 概述
- 8.2 无模型不确定性的控制问题
- 8.3 使用鞅表示模型误设
- 8.4 两类算子
- 8.5 模型不确定性的控制问题
- 8.6 $\pi_1 = \pi_2$ 的例子
- 8.7 信号扭曲隐含的最坏情形模型
- 8.8 递归的多元先验概率模型
- 8.9 风险敏感和复合型彩票
- 8.10 其他的例子

8.11 结束语
第9章 脆弱的信念和不确定性价格
9.1 概述
9.2 随机贴现和风险
9.3 三种信息结构
9.4 风险价格
9.5 完全信息下的学习
9.6 稳健性担忧的价格效应
9.7 机制说明
9.8 结束语
附录
第10章 信念、怀疑和学习：评估宏观经济风险
10.1 概述
10.2 理性预期和计量经济学家
10.3 统计精度
10.4 风险价格和统计模糊
10.5 统计挑战
10.6 学习
10.7 信念与偏好
10.8 学习和不确定性溢价
10.9 扩展
10.10 结束语
第11章 模糊的三种类型
11.1 说明性模型
11.2 无稳健性模型
11.3 概率扭曲表示
11.4 模糊的第一种类型
11.5 无稳健性的异质性信念
11.6 第二种模糊类型
11.7 模糊的第三种类型
11.8 比较
11.9 数值例子
11.10 结束语
附录
参考文献
• • • • • (收起)

[经济世界的不确定性_下载链接1](#)

标签

经济

经济学

哲学

演化经济学

方所看到

评论

[经济世界的不确定性_下载链接1](#)

书评

[经济世界的不确定性_下载链接1](#)