

结构宏观计量经济学



[结构宏观计量经济学 下载链接1](#)

著者:David N.DeJong

出版者:上海财经大学出版社

出版时间:2010-1

装帧:

isbn:9787564206741

《结构宏观计量经济学》既适合作为宏观经济学和计量经济学等专业研究生引导性课程的补充资料，又可作为那些立志追求宏观经济学应用研究的高年级研究生的基础教程。这门课的讲义即《结构宏观计量经济学》的前身，其设计是着眼于后者这一目的。对于专业学术研究人员而言，《结构宏观计量经济学》的历史视角，以及它对方法论的统一表述，也使其成为很有价值的资料。

作者介绍:

David N. DeJong is Professor of Economics at the University of Pittsburgh. Chetan Dave is Assistant Professor of Economics at the University of Texas, Dallas.

目录: 序言
第一部分 模型和数据准备
1 绪论 1.1 背景 1.2 概述 1.3 记号
DSGE模型的逼近和求解 2.1 线性化 2.2 求解方法
3 去趋和分离周期 3.1 去趋 3.2 分离周期
3.3 欺骗性
4 时间序列行为概述 4.1 两个有用的简化模型 4.2 统计概述 4.3 卡尔曼滤波
DSGE模型：三个例子 5.1 模型 I：一个实际经济周期模型 5.2
模型 II：垄断竞争和货币政策 5.3 模型 III：资产定价
第二部分 实证方法
6 校准 6.1 历史渊源与哲学 6.2 实施 6.3 经济周期的福利成本 6.4 生产率冲击和经济周期波动 6.5
资产溢价之谜 6.6 批判和拓展
7 矩匹配 7.1 回顾 7.2 应用 7.3 在DSGE模型中的应用 7.4
实证应用：实际商业周期矩匹配 8 极大似然法 8.1 概要 8.2 介绍和历史背景 8.3
最优化算法的入门 8.4 病态似然面：问题与解答 8.5 模型诊断和参数稳定性 8.6
实证应用：识别商业周期波动的来源 9 贝叶斯方法 9.1 目标概述 9.2 准备 9.3
用结构模型作为简化形式分析中先验信息的来源 9.4 结构模型的直接实施 9.5 模型比较
9.6 用RBC模型作为预测时先验信息的来源 9.7 估计并比较资产定价模型
第三部分
超出线性化 10 非线性逼近方法 10.1 标记符号 10.2 投影法 10.3 值函数和政策函数迭代 11
非线性逼近的实证应用 11.1 模型模拟 11.2 用粒子滤波法进行完全信息分析 11.3
线性和非线性模型逼近
参考文献
• • • • • (收起)

[结构宏观计量经济学](#) [下载链接1](#)

标签

计量经济学

经济学

宏观经济学

经济

实证

高级宏观经济学

方法论

DSGE

评论

前面公式比较多，看得累，但好歹知道在干啥。从第二部分开始就翻译得不说人话了。当然，这还是一本不错的书。

[结构宏观计量经济学](#) [下载链接1](#)

书评

首先，这本书是想搞DSGE的研究者的一本必读（备）书。属于“指南类”的书籍。所谓“指南类”类的书籍，就是它把目前DSGE用到的核心方法和技术都切中要害的总结了，并给出了应用实例；而不是偏重于DSGE方法的某一种技术。

其次，本书第二版有两章写的我个人认为不好（起码我看…

[结构宏观计量经济学](#) [下载链接1](#)