

动态随机一般均衡模型及其应用



[动态随机一般均衡模型及其应用 下载链接1](#)

著者:刘斌

出版者:中国金融

出版时间:2010-10

装帧:

isbn:9787504956132

《动态随机一般均衡模型及其应用》系统地介绍DSGE模型的开发和应用，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模型开发与应用的技术细节，并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。动态随机一般均衡模型（DSGE模型）研究的问题涉及经济景气分析、货币政策和财政政策、国际贸易、汇率的改革、收入分配及金融稳定等众多相关领域。

作者介绍:

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。

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、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比较和选择 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 模型的比较与选择
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 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
• • • • • (收起)

[动态随机一般均衡模型及其应用](#) [下载链接1](#)

标签

经济学

DSGE

金融数学

经济

推荐书籍

计量经济

宏观经济学

评论

可能是排版比较乱，也可能是我数学不扎实，有不少公式没看透。不过这本书内容挺广泛的，指出了很多之前疑惑的问题，比如为啥要滤波怎么求带期望的方程之类的。缺少参考文献位置的标注是另一大遗憾。

[动态随机一般均衡模型及其应用](#) [下载链接1](#)

书评

[动态随机一般均衡模型及其应用](#) [下载链接1](#)