

# 《动态随机一般均衡模型及其应用》

## 图书基本信息

书名：《动态随机一般均衡模型及其应用》

13位ISBN编号：9787504963305

出版时间：2014-3-1

作者：刘斌

页数：351

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介以及在线试读，请支持正版图书。

更多资源请访问：[www.tushu000.com](http://www.tushu000.com)

# 《动态随机一般均衡模型及其应用》

## 内容概要

《动态随机一般均衡模型及其应用（第2版）》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、模型的选择和选择以及最优经济政策的选择等几个方面详细介绍DSGE模型开发与应用的细节，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及其应用》

## 作者简介

刘斌，管理工程博士，研究员，现供职于中国人民银行研究局，兼任对外经济贸易大学教授，中国科学院管理、决策与信息系统开放实验室客座研究员。主要研究方向为经济建模、宏观经济分析与预测、货币政策分析、计量经济学等。曾赴英格兰银行、荷兰丁伯根研究所（Tinbergen Institute）进行宏观经济模型及货币政策分析的合作研究，多次参加有关宏观经济模型及货币政策分析的国际会议；主持和参与过国家自然科学基金和其他部委等多项课题的研究，出版专著多部：在国内外核，刊物发表论文多篇，分别获得中国金融学会第六届、第七届、第八届及第九届优秀论文三等奖、二等奖、三等奖及三等奖，作为主持人分别获得2007年度、2008年度、2009年度、2010年度及2012年度中国人民银行重点研究课题一等奖、二等奖、三等奖、二等奖及二等奖。目前在中国人民银行主要负责经济模型的开发和应用、经济分析和预测以及经济政策分析等方面的工作。

## 书籍目录

### 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、稳态特性

##### 二、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、如何将模型变换成平稳的形式

##### 三、如何将非线性模型变换成线性模型

#### 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 模型的选择与比较

##### 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

#### 七、结论和建议

### 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

### 第五节 我国经济波动的根源分析及政策选择

#### 一、分析经济波动的根源采用的两种方法

#### 二、模型中的不确定性刻画

#### 三、历史分解和误差分解技术

#### 四、关于我国经济波动的根源分析实证结果

#### 五、经济冲击对政策选择的影响及我国经济政策的改进方向

#### 六、结论

#### 参考文献

# 《动态随机一般均衡模型及其应用》

## 精彩短评

1、介绍DSGE比较好的一本中文书，不过在具体内容的详略安排上还有些小缺陷

# 《动态随机一般均衡模型及其应用》

## 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:[www.tushu000.com](http://www.tushu000.com)