

# 《理性预期计量经济学》

## 图书基本信息

书名：《理性预期计量经济学》

13位ISBN编号：9787300218547

出版时间：2016-1

作者：Lars Peter Hansen, Thomas J. Sargent

页数：240

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)

# 《理性预期计量经济学》

## 内容概要

理性预期计量经济学领域的经典著作，是两位诺贝尔经济学得主汉森和萨金特及其合作者使得理性预期计量经济学在实证研究中更具有可操作性的努力的总结。该书在讲授最小二乘预测理论（第2章）的基础上，围绕理性预期计量分析的主要的分析框架，一方面解决结构宏观计量分析中交叉方程约束所带来的问题（第3、7、8和9章），另一方面解决从预测误差中识别基本冲击时存在的困难（第4、5、6和10章），从而扩展和进一步完善了理性预期计量经济分析的框架，使其更具有可操作性。该书对于理解理性预期计量经济学建模的主要方法和过程具有重要的理论和指导意义。

# 《理性预期计量经济学》

## 作者简介

拉尔斯·彼得·汉森 (Lars Peter Hansen) ，2013年诺贝尔经济学奖得主。著名宏观经济学家、芝加哥经济学派代表人物之一、芝加哥大学经济和社会科学资深讲座教授(David Rockefeller Distinguished Service Professor)。

托马斯·J·萨金特(Thomas J. Sargent)2011年诺贝尔经济学奖得主，纽约大学的伯克利讲席经济学和商学教授 ( Berkley Professor of Economics and Business ) 以及胡佛研究所的高级成员。

## 书籍目录

### 第1章 导论

移动平均模型的各种表述方法

精确线性理性预期模型

向量自回归模型诠释中的两个难题

三篇连续时间理性预期模型论文

检验现值预算平衡问题

### 第2章 最小二乘法预测理论讲义

1.引言

2.预测问题

3.涉及投影的重要结论

4.子空间的无穷序列

5.条件期望

6.线性预测理论

附录

### 第3章 精确线性理性预期模型:设定与估计

引言

1.一般模型

2.例子

3.识别

4.一阶差分隐含的限制条件

5.似然估计法和推断

6.将干扰项解释为隐藏变量的非精确模型

结论

### 第4章 向量自回归模型诠释中的两个难题

引言

理性预期计量经济学

1.未揭示的 ( unrevealing ) 的随机过程

2.时间加总

3.结论

附录

### 第5章 现值预算平衡和消费与税收鞅模型的时间序列含义

1.引言

2.现值预算平衡的含义

3.鞅模型

4.不可分偏好

5.一个实证例子

6.逼近误差

7.可变实际利率

8.结论

附录

### 第6章 预期现值预算平衡的含义:应用于战后美国数据

1.引言

2.预期净现值预算平衡的含义

3.应用于战后美国数据

4.结论

### 第7章 动态经济中连续时间递归线性模型的快速求解法

引言

- 1.最优资源配置问题
  - 2.重要的线性算子
  - 3.线性约束
  - 4.最优线性规制问题
  - 5.迭代求解方法
  - 6.投资的调整成本模型
  - 7.永久收入模型
- 附录A  
附录B  
附录C
- 第8章 用于连续时间线性理性预期模型的预测公式
- 1.卷积与预测
  - 2.变换
  - 3.例子
  - 4.向量信息结构
  - 5.非平稳性
- 第9章 离散时间数据的连续时间理性预期模型识别
- 1.引言
  - 2.连续时间模型
  - 3.当  $(K, z)$  是一阶马尔科夫过程时的识别问题
  - 4.连续时间中  $z$  严格外生于  $K$  时的识别问题
  - 5.结论
- 附录
- 第10章 经济时间序列的跨期加总
- 引言
- 1.问题的定义
  - 2.离散抽样过程的新息
  - 3.抽样过程的MAR
  - 4.格兰杰因果关系
  - 5.单元平均数据
  - 6.抽样区间趋于零时离散MAR的收敛性
  - 7.结论
- 附录:  $Y$  的自回归表述
- 参考文献

# 《理性预期计量经济学》

## 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)