

<<递归宏观经济理论>>

图书基本信息

书名：<<递归宏观经济理论>>

13位ISBN编号：9787300065731

10位ISBN编号：7300065732

出版时间：2005-10

出版单位：人民大学

作者：杨奎斯特

页数：548

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：<http://www.tushu007.com>

## <<递归宏观经济理论>>

### 内容概要

递归方法是动态宏观经济学中的一个强有力的工具。

本书不但包含了递归工具的入门材料，如资产定价的标准应用，还包含了一些高级材料，如对声誉机制和契约设计的分析。

在讲述这些工具时，本书给出了足够的技术细节，使得读者可以自如地处理实际问题。

这些应用覆盖了许多重要的专题，例如均衡资产价格、市场不完全性、财富分布、通货膨胀的财政与货币理论、政府债务、最优劳动和资本税收、时间一致性和可信政府政策、最优社会保险、经济增长，以及劳动力市场动态学等。

在需要数值模拟的地方，本书不仅提供了怎样处理的建议，还给出了供进一步阅读的参考文献。

## &lt;&lt;递归宏观经济理论&gt;&gt;

## 书籍目录

第1章 时间序列 两个有用的工具 马尔科夫链 平稳分布 渐近平稳 期望 预测函数 模拟马尔科夫链 似然函数 线性随机差分方程 矩 刺激反应函数 预测和贴现 随机贴现因子 回归谱 例子 估计 结束语 附录：线性差分方程 练习 第2章 动态规划 序贯问题 三种计算方法 柯布一道格拉斯约束，对数偏好 欧拉方程 欧拉方程的一个例子 随机控制问题 结束语 练习 第3章 动态规划的实际应用 维数的限制 状态空间的离散化 离散状态的动态规划 霍华德改进算法的应用 数值方法 修正的策略迭代 贝尔曼方程的例子 例1：计算期望效用 例2：风险--敏感偏好 例3：经济周期的成本 多项式逼近 推荐的计算策略 切比雪夫多项式 算法：总结 保形样条函数 结束语 第4章 线性二次动态规划 引言 最优线性调节器问题 值函数迭代 贴现的线性调节器问题 策略改进算法 随机最优线性调节器问题 确定性等价的讨论 线性调节器问题中的影子价格 稳定性 拉格朗日公式 卡尔曼滤波 穆斯的例子 约万诺维奇例子 结束语 附录A：矩阵公式 附录B：线性二次逼近 范例：随机增长模型 基德兰德和普雷斯科特的方法  $Z$  的决定 对数线性逼近 趋势移动 练习 第5章 搜寻，匹配和失业 引言 预备知识 非负随机变量 保均展形 麦考尔的跨期工作搜寻模型 失业保险金和保均展形的影响 浴缸模型 等待时间 辞职 解雇 职业选择模型 约万诺维奇匹配模型的一个简化形式 约万诺维奇模型的长期版本 贝尔曼方程 结束语 附录：用数值动态规划来进行更多的练习 例4：搜寻 例5：约万诺维奇模型 工资分布 分离概率 数值例子 练习 第6章 递归(局部)均衡 均衡的概念..... 第7章 完全市场的竞争性均衡 第8章 世代交叠模型 第9章 李嘉图等价性 第10章 资产定价 第11章 经济增长 第12章 带承诺的最优税收 第13章 自我保险 第14章 不完全市场模型 第15章 最优社会保险 第16章 可信的政府政策 第17章 通货膨胀的财政货币理论 第18章 信用与货币 第19章 均衡、搜寻与匹配 第20章 泛函分析 附录 第21章 控制与滤波 附录 参考文献 人名索引 索引 译后记

<<递归宏观经济理论>>

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:<http://www.tushu007.com>