

<<货币经济学研究>>

图书基本信息

书名：<<货币经济学研究>>

13位ISBN编号：9787509508053

10位ISBN编号：7509508053

出版时间：2008-8

出版时间：中国财政经济出版社一

作者：陈浪南 等著

页数：311

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>

## <<货币经济学研究>>

### 内容概要

本书的第一部分为中央银行与政府的关系研究，该部分通过建立模型研究政府与中央银行的关系，即在微观经济结构约束下求解长短期中政府与中央银行的最优委托代理关系，由此得到中央银行的目标规则；第二部分为我国货币、商品价格和真实部门之间的信息传导研究，研究从货币到价格和真实部门的传导机制。

该部分通过分析我国五个宏观经济变量之间的均衡、调整即因果联接等关系探讨了我国货币对价格及真实部门的影响；第三部分为基于一般债券和TIPS的通货膨胀期限结构模型研究，结合利率期限结构研究的方法研究了通货膨胀的期限结构；第四部分以多因素CIR为基础，运用卡尔曼滤波来模拟和估计我国国债利率的期限结构。

## &lt;&lt;货币经济学研究&gt;&gt;

## 书籍目录

第一篇 货币政策目标规则——中央银行与政府关系模型 内容提要 第一章 引言 第一节 中央银行独立性思想追溯 第二节 中央银行独立性内涵 第二章 文献综述 第一节 货币政策时间不一致性问题 第二节 问题的解决方案 第三节 其他 第三章 基本框架和框架的扩展 第一节 基本框架 第二节 文献与框架 第三节 框架的扩展 第四章 政府与中央银行的最优委托代理关系 第一节 短期内政府与中央银行的委托代理关系 第二节 长期中政府与中央银行的委托代理关系 第三节 长短期最优货币政策委托比较 第四节 结论 附录 附录一 短期最优货币政策委托求解 附录二 长期最优货币政策委托求解 参考文献第二篇 我国货币、商品价格和真实部门之间的信息传导研究 内容提要 第一章 引言 第二章 文献综述 第一节 相关命题的研究述评 第二节 关于信息传导的研究方法述评 第三章 线性方法下信息传导模型与估计 第一节 均衡关系及稳定性分析 第二节 动态关系检验 第四章 非线性方法下信息传导模型与估计 第一节 非对称性信息传导模型 第二节 差别体制转换信息传导模型 第三节 平滑转移 (STAR) 模型 第五章 线性方法下的实证结果与分析 第一节 数据说明 第二节 实证结果与分析 第六章 非线性方法下的实证结果与分析 第一节 非对称模型误差修正模型下实证结果与分析 第二节 体制转换模型下的实证结果与分析 第三节 平滑转移模型下的实证结果与分析 第七章 结论 参考文献第三篇 基于一般债券和TIPS的通货膨胀期限结构模型研究 内容提要 第一章 引言 第一节 研究的理论基础 第二节 TIPS架构 第二章 文献综述 第一节 基于一般债券的通货膨胀期限结构模型的发展 第二节 基于TIPS的通货膨胀期限结构模型的发展 第三章 基于一般债券的通货膨胀期限结构模型 第一节 模型推导的理论基础 第二节 模型假设 第三节 通货膨胀双因素模型 第四节 通货膨胀双因素模型的推导 第五节 小结 第四章 基于TIPS的通货膨胀期限结构模型 第一节 零息票TIPS的可叠加理论 第二节 无套利模型的假设条件及推导步骤 第三节 无套利模型的推导 第四节 小结 第五章 结论 参考文献第四篇 国债收益率期限结构研究 内容提要 第一章 引言 第一节 期限结构与收益率曲线 第二节 期限结构理论 第三节 国债利率期限结构的拟合和估计 第二章 文献综述 第一节 国内外的研究述评 第二节 难点与研究创新 第三章 数据处理与解读 第一节 交易所国债的交易规则 第二节 样本选取 第三节 选取零息票收益率的必要性 第四节 零息票收益率曲线的确定 第五节 期限完备情况 第六节 沪市和深市期限结构的一致性检验 第七节 沪市和深市对于研究我国国债的期限结构谁更具代表性 第四章 研究方法 第一节 模型的假设检验 第二节 卡尔曼滤波方法 第五章 期限结构的估计结果与分析 第六章 模型的诊断校验 第一节 诊断校验 第二节 模型不充分性的成因分析 第七章 结论与建议 第一节 结论 第二节 政策建议 第八章 模型的修正与今后的研究方向 第一节 模型 (4-41) 所满足的状态方程 第二节 满足模型 (4-41) 的债券收益率 第三节 调整因素的权重附录 附录一 用来进行卡尔曼滤波分析的系统方程 附录二 银行间市场和交易所市场回购利率的统一性参考文献

## 章节摘录

第二节 中央银行独立性内涵 弗里德曼 (Friedman, 1962) 对中央银行独立性给出的定义是, “中央银行应该是与立法机关、行政部门以及司法部门并列, 成为政府的一个独立的分支机构。” 弗里德曼认为的中央银行独立性是一种高度的独立性, ‘他把中央银行与国家政权机关相提并论。

埃吉芬格 (Eijffinger, 1997) 则从内容上说明中央银行独立性的内涵。

他认为中央银行独立性涉及三个方面, 一是人事上的独立性; 二是赤字融资上的独立性; 三是政策的独立性。

而政府在这三方面的影响应当尽量排除或弱化。

埃吉芬格认为对于像中央银行这样一个如此重要的公共机构, 其人事任免上要完全排除政府的影响是不可能的, 因此, 中央银行人事上的独立性是指政府对中央银行任命程序的影响程度。

它具体表现在任命程度、任期长短和解除职务的程序等方面。

而在赤字融资的独立性方面, 如果政府能通过中央银行信用直接或间接地为政府支出融资, 对中央银行施加影响, 那么中央银行在赤字融资上无独立性可言。

直接涉及的中央银行信用是指货币政策从属于财政政策。

间接涉及的中央银行信用可能产生两种情形: 一是中央银行成为政府的出纳; 二是中央银行负责政府债务的管理。

政策上的独立性是指中央银行制定和执行货币政策的自主权。

德贝里和费舍尔 (Debell和Fischer, 1994) 把政策上的独立性分为政策目标上的独立性和政策工具上的独立性。

政策目标上的独立性是指中央银行自己选择政策目标, 如稳定物价、充分就业、经济增长或同时两个或多个等等。

.....

<<货币经济学研究>>

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>