

<<21世纪数量经济学（第12卷）>>

图书基本信息

书名：<<21世纪数量经济学（第12卷）>>

13位ISBN编号：9787509734711

10位ISBN编号：7509734711

出版时间：2012-7

出版时间：社会科学文献出版社

作者：汪同三，张卫国 编

页数：421

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>

## <<21世纪数量经济学（第12卷）>>

### 内容概要

《21世纪数量经济学（第12卷）》是中国数量经济学会2011年年会的优秀论文集，共30篇，分为五个部分：数量经济理论与方法，宏观经济，金融、资本市场，企业、产业经济，区域经济、协调发展。

入选的这些论文均有较高的学术水平，具有一定的理论意义或实践意义，从一个侧面代表了中国数量经济学的研究水平。

《21世纪数量经济学（第12卷）》是从事数量经济教学研究工作者的重要参考书。

## 书籍目录

一 数量经济理论与方法 带异质线性趋势的二元选择面板模型偏误纠正估计 EC + IO联合模型研究--基于四川省投入产出表的实证分析 一类改进的空间相关系数广义矩估计方法 一个包含异质信念的GARCH模型 一种基于混频数据的中国经济景气一致指数 金融市场记忆模式识别：基于方差标度指数 空间计量经济学文献综述 二 宏观经济 中国月度居民消费价格指数预测--基于时间序列的BP神经网络和ARMA模型对比分析 人民币有效汇率与物价的阈值协整关系实证 收入差距、农村居民消费与二元财政--基于VECM模型的实证分析 家庭社会网络与居民储蓄行为--基于农村住户调查数据的实证检验 三 金融 资本市场 再检验股市波动的杠杆效应：一种新的方法 基于门限协整理论的股指期货跨市场套利研究 特质风险和股票预期报酬的关系--基于投资者情绪的解释 不对称投资行为的市场效应与计算实验研究 基于贝叶斯网络的商业银行中小企业信贷准入筛选模型研究 金融集聚与经济增长关系实证分析 中国股指期货市场的推出对股票市场的影响--基于国际价格联动性和波动溢出效应的研究 四 企业 产业经济 中国工业部门技术效率区域比较与 收敛性 中国商业银行多元化经营水平与其绩效关系研究 基于三维度模型的产业集群识别研究 基于资源型两阶段DEA模型的中国商业银行效率实证分析 信息技术行业人力资本结构和高管薪酬实证研究 从产权性质看中国工业企业创新能力 董事会特征与企业可持续增长--基于中国A股上市公司的面板数据 五 区域经济 协调发展 中国省域农村教育消费水平空间效应实证分析 基于投入产出分析的环渤海地区的CO2排放测量方法运用与分析 城市圈辐射效应实证研究--以湖北城市群及武汉城市圈发展为例 资源环境约束下中国省际全要素生产率测度分析--基于Global Malmquist-Luenberger指数 省域旅游经济增长影响因素的空间计量模型及应用

## 章节摘录

版权页：插图：更有部分学者将研究视角转向汇率传递效应的变化趋势及影响因素上，并且普遍的观点是近些年来工业化国家与新兴市场国家的汇率传递率均出现下降趋势，这种趋势与通胀率存在着一定的关系。

Gagnon和Ihrig（2001）通过选取11个工业化国家样本、Otani等（2003）以日本为研究对象、Frankel等（2005）对76个发展中国家的八类产品，以及Michele Ca'Zorzi等（2007）对12个新兴市场国家的研究，都得出了在20世纪90年代汇率变化对进口品价格的传递效应出现下降趋势的结论，并发现国际通货膨胀率降低的环境是导致这一趋势的主要原因。

国内学者的大多数研究结果均表明人民币汇率传递效应是不完全的。

理论方面，孙立坚等（2003）建立了新开放宏观经济学模型来检验内生货币政策在价格传递机制中的制约作用，发现货币政策可以制约汇率和外国价格对本国价格的传递效应。

实证上近些年的研究成果较多，采用的方法主要有以下几种：运用单方程协整及误差修正模型方法，卜永祥（2001）和毕玉江、朱钟棣（2006）研究了人民币汇率变动对CPI的价格传递效应，发现人民币汇率变动对CPI的传递不完全并存在时滞，进口价格对人民币汇率变动的弹性远高于CPI对汇率变动的弹性。

吕剑（2007）发现长期人民币汇率变动显著正相关于国内物价水平，短期内人民币汇率变动对物价指标有不同的传递效应。

陈学彬等（2007）基于22种HS分类出口商品的面板数据考察中国出口商品总体和各行业分类的汇率传递率，发现人民币汇率升值时各行业的出口价格传递具有差异性。

VAR模型方法在汇率传递效应问题的研究上应用得比较广泛，比如封北麟（2006）研究了人民币名义有效汇率变动对CPI和PPI及其分类指数的传递效应，发现汇率变动对PPI及其分类指数的影响显著大于对CPI及其分类指数的影响，而且汇率传递效应存在显著的行业差别，傅雄广等（2008a，2008b）也检验出人民币名义有效汇率对不同消费品价格的传递率存在显著差异，并发现名义有效汇率对进口品价格传递效应的绝对值和国内通货膨胀环境有关。

<<21世纪数量经济学（第12卷）>>

编辑推荐

《21世纪数量经济学(第12卷)》由汪同三、张卫国主编，集结中国数量经济学会2011年年会的优秀论文30篇，内容涉及五个方面：数量经济学理论与方法，宏观经济，金融、资本市场，企业、产业经济，区域经济、协调发展。

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>