

<<应用宏观经济研究方法>>

图书基本信息

书名：<<应用宏观经济研究方法>>

13位ISBN编号：9787564204815

10位ISBN编号：7564204818

出版时间：2009-7

出版时间：上海财大

作者：卡纳瓦

页数：406

译者：周建

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>

<<应用宏观经济研究方法>>

前言

Methods for Applied Macroeconomic Research一书的中文翻译版《应用宏观经济研究方法》，经过一年多的艰苦努力工作终于问世了。

该书系统全面地介绍了20世纪70年代以来在宏观经济学应用研究领域的各种主要分析方法和模型，内容丰富且体系庞大，具有显著的学术研究价值和应用价值。

原著自2007年出版以来，在学术界曾引起强烈的关注。

20世纪70年代以来至今已近四十年，世界政治与经济形势及其格局发生了巨大的深刻变化，指导经济政策制订的宏观经济理论和方法也随之发生了显著的改变，特别是20世纪80年代以来，随着苏联解体、东南亚金融危机的蔓延、欧盟组织的一体化进程推进和最终形成、美国次贷危机所进一步演化的金融危机等众多重大事件的深远影响，世界各国政府不得不重新反思和审视它们曾经备受推崇和实施的各经济政策的合理性和科学性。

政府政策的制订自然离不开众多经济学家的聪明才智和卓越贡献，为了解决现实世界中眼花缭乱、错综复杂甚至是令人极其困惑乃至迷茫的经济难题，各种经济学派及其从事理论研究和实践政策分析的经济学家们都陆续提出了层出不穷的相应“理论”和“观点”。

然而，“理论”和“观点”虽多，但是真知灼见却寥寥无几；空谈容易，严格论证却十分困难，而伴随着各种形形色色“理论”和“观点”的重要支撑则是实证分析或者经验分析的检验和证明。

因此，宏观经济研究的各种方法和手段也就成为在现代经济学理论研究和确认其理论正确性的过程中不可或缺的重要基石。

在经济学作为一种社会显学而被越来越多的人所认可的今天，其理论研究固然重要，但是作为理论检验的“试金石”——方法也绝不可少；特别是在伴随着现代计算机技术突飞猛进发展的当代，这点显得尤为重要，因为计算技术的发展和前进使我们各种先进和前沿方法的实现已变得不再是遥不可及。

四十年前只能由经济学权威和大师们在实验室里进行应用的分析手段和方法，如今在被普通大众研究者所掌握的同时，再也不会因为计算技术等方面的障碍而成为一座不可逾越的大山。

<<应用宏观经济研究方法>>

内容概要

本书有着与其他类似相关书籍不同的四大特色： 1. 本书内容全面。20世纪70年代应用于宏观经济学的最重要的分析方法在本书中都有所体现和涉猎，具体包括：动态随机一般均衡模型、向量自回归方法、广义矩估计法、广义模拟方法、校准法、动态宏观面板方法、贝叶斯结构向量自回归方法等。这些方法和模型无论是在一般的宏观经济学分析中，还是在专门的计量经济学研究中都占据着非常重要的位置，只不过它们在不同的研究体系中侧重点不同，有所差异而已。在计量经济学领域中，以上方法更多偏向于理论研究和方法本身的分析；而在宏观经济研究中，它们则更多偏向于实践应用。当然，无论什么体系，本书都从应用分析的角度把它们包含。

2. 本书内容前沿。

本书涉及的所有方法都是20世纪70年代以来新近发展的领域，有的方法在现代宏观经济研究和计量经济学分析中都已高频率地被多次使用，例如，动态随机一般均衡模型、向量自回归方法、校准法等；但是，还有类似于动态宏观面板方法、贝叶斯结构向量自回归方法等众多学术前沿领域，虽然它们的理论研究也在进一步推进和发展之中，但是本书把它们作为非常重要的内容也都进行详细讲解。科学使用这些方法无疑将显著地提高我国现代宏观经济学的整体研究水平和能力，由此也能够为更加深入分析越来越复杂的经济问题提供新颖的研究手段和途径。因此，这些前沿方法内容的介绍为现代宏观经济学的研究注了新鲜血液和活力。研究者们在使用这些分析方法的过程中，也容易产生新的灵感和研究成果。

3. 本书应用性强。

在本书中，所有的方法都是以应用分析和政策研究为主，并不过重地去讨论方法本身及其性质问题，这对于做实证研究和经验分析的学者来讲，具有极其重要的现实意义。当然，方法本身更需要长时间地进行深入研究，只有这样，才可能使我们的应用分析有所依靠。方法的研究需要靠计量经济学家去推动，而应用者则更应关心如何将这些方法“用得好”、“用得巧”、“用得妙”。

随着自21世纪以来，我国经济学研究现代化的深入推进，大多数国内外经济学家都有一致共识——不懂分析方法的经济学研究范式会越来越多地受到各种限制，而采用科学的研究方法和规范的分析模式来研究经济问题已经成为主流趋势。

以上共识已是无须争论的话题，因为在经济全球化的今天，各种经济问题错综复杂，相互影响，如果没有科学的方法进行系统分析，很难想象仅靠一个人的思辨能力能够做出更加符合现实价值的前瞻性成果。

本书所涉猎的方法都从应用角度出发，集中于讨论如何解决和研究现实经济问题，毫无疑问，这对于数理基础不强的研究者们来讲大有裨益，他们可以通过本书的应用举例和分析过程，将已有方法“移植”到自己所要研究的问题中去，为真正深入分析经济现象提供坚实的数理基础。

当然，在“移植”过程中不能简单地照搬照用，而更应当注重科学合理性。

4. 本书案例分析新颖，富有深刻的经济理论指导和现实应用价值。

本书中使用了大量的实际经济问题案例，详细充分地采用现代方法对其进行细致剖析，这些案例普遍基于世界各国的经济现实而提出，无论是从理论层次分析上，还是从政策研究上，均具有显著的学术意义和重要的研究价值。

读者完全可以通过本书中的案例分析而受到较大的启发，甚至也可以直接选取这些重要的相关问题做进一步深入研究。

因此，本书拓宽了已有经济学相关领域的研究范围，为进一步加强和提高现有经济学理论和应用研究水平，提供了更加广阔的分析思路和方法。

<<应用宏观经济研究方法>>

书籍目录

译者序序言1 准备知识1.1 随机过程1.2 收敛的概念1.3 时间序列概念1.4 大数定理1.5 中心极限定理1.6 谱分析的元素2 动态随机一般均衡模型的解答和模拟2.1 一些有用的模型2.2 近似方法3 提取和测量周期性信息3.1 统计分解3.2 混合分解3.3 经济分解3.4 时间总体和周期3.5 收集周期性信息4 向量自回归模型4.1 沃尔定理4.2 模型设定4.3 矩和VAR (q) 的参数估计4.4 报告VAR结果4.5 识别4.6 相关问题4.7 验证含有VAR的DSGE模型5 GMM和模拟估计量5.1 广义矩估计和其他标准估计量5.2 线性模型中的IV估计5.3 GMM估计：概述5.4 DSGE模型的GMM估计5.5 模拟估计量6 似然法6.1 卡尔曼滤波6.2 似然函数的预测误差分解6.3 数字技巧6.4 DSGE模型的ML估计6.5 两个例子7 校准7.1 定义7.2 公认的部分7.3 选择参数和随机过程7.4 模型评价7.5 测量的灵敏度7.6 储蓄、投资和减税：一个例子8 动态宏观面板8.1 从经济理论到动态面板8.2 同质性动态面板8.3 动态异质性8.4 是否需要混合数据？8.5 货币是超中性的吗？

9 贝叶斯方法介绍9.1 预备知识9.2 决策理论9.3 推断9.4 分层和实证贝叶斯模型9.5 后验模拟器9.6 稳健性9.7 估计西班牙规模报酬10 贝叶斯向量自回归10.1 m个变量的VAR (q) 的似然函数10.2 VAR的先验10.3 结构性BVAR10.4 时间上系数可变的BVAR10.5 面板数据的VAR模型11 贝叶斯时间序列和DSGE模型11.1 因子模型11.2 随机扰动模型11.3 马尔科夫转换模型11.4 贝叶斯DSGE模型附录 统计分布参考文献

<<应用宏观经济研究方法>>

章节摘录

加诺瓦 (Canova, 2002a) 说明了, 作为对技术和货币政策冲击的响应, 这两个模型都产生了一些稳健的符号约束条件。

例如, 作为对政策性扰动的响应, WK经济模型产生了同时向相反方向变化的通货膨胀和总产出、通货膨胀和实际平衡、通货膨胀和期限结构的坡度, 以及同时向相同方向变化的总产出和实际平衡。在SP经济模型中, 通货膨胀和总产出及其滞后都是正向同期相关的, 和总产出的前导是负向同期相关的。

通货膨胀和实际平衡之间的关系在任何地方都是负相关的, 在总产出和实际平衡之间, 对于实际平衡的滞后是正相关的, 对其同期和前导都是负相关的。

最后, 通货膨胀和期限结构的坡度在任何地方都是负相关的。

我们可以利用其中一部分或者全部约束条件来刻画货币冲击。

这里, 我们选择了WK模型中总产出、通货膨胀和期限结构坡度的同期横向相关的约束条件, 同时选择了SP模型中总产出、通货膨胀和实际平衡的横向相关的约束条件。

我们将上述条件施加于一个由总产出、通货膨胀、实际平衡、期限结构的坡度和劳动生产率构成的VAR模型, 利用从1980:1到1998:4时期的美国、英国和欧元的数据。

我们发现, WK的符号约束不能够揭示英国的货币冲击, SP中的符号约束也不能在欧元区产生货币冲击。

也就是说, 在10 000个抽取的样本中, 对于 和我们只能找出不到0.1%的样本是满足约束条件的。

由于简化式残差的组合不能产生对于总产出、通货膨胀和期限结构坡度 (或者实际平衡) 具有符号约束条件的横向关系, 在至少一个数据库中, 两个模型都和其货币冲击响应的动态移动不相符。

有人可能会在这一步停止, 然后重新设置模型, 或者利用数据中满足约束条件的部分继续进行检验, 例如, 已识别的货币冲击的其他 VAR变量的动态响应。

对于为什么一个实际平衡 (或者坡度) 和劳动生产力的比较可能更好得说明模型对数据近似估计的质量, 这里至少有两点原因。

首先, 我们想要了解已识别的货币冲击是否对流动性产生影响, 这一点在两个模型中都有所体现。

这里, 可以利用一个简单的检验来判断一个识别方法是否有意义 [参见高登和里皮 (Gordon and Leeper, 1994)]。

其次, 通常可以运用劳动生产力的动态变化来区分弹性价格实际商业周期和经济波动的粘滞价格需求驱动的解释 [参见加利 (Gali, 1999)]。

由于在两个模型中, 劳动生产力对于紧缩的货币冲击是相似的 (小时数比总产出下降得更快, 劳动生产力提高), 检验定性的数据是否符合预测是很有意思的。

图4.7描述了对于每个数据库的两个变量的响应 (直线) 以及从两个模型中得到的响应 (虚线), 标准化以使得货币政策的新息是一致的。

这里可以得到两个结论。

第一, WK中的识别方法不能够揭示美国和欧元区的劳动生产力的响应的符号和形状, 并且在欧元区产生缺乏流动性效应的货币扰动。

第二, 在SP模型识别方法中, 货币冲击产生的期限结构的坡度的响应在美国就会有错误的符号, 利用英国的数据就缺乏持续性。

<<应用宏观经济研究方法>>

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>