第一图书网, tushu007.com

<<完全时间一致性、确定性与稳健最优 >

图书基本信息

书名：<<完全时间一致性、确定性与稳健最优利率规则>>

13位ISBN编号：9787030315960

10位ISBN编号：7030315960

出版时间：2011-6

出版时间：科学出版社

作者：艾洪　等著

页数：184

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

内容概要

《完全时间一致性、确定性与稳健最优利率规则-基于lre模型的分析与扩展》在完全时间一致性标准下对传统的lre模型进行了改进和扩展。
在改进的一般lre模型框架内，本书分析了最优利率规则的时间一致性、确定性与稳健性等内在属性，并考察了以taylor规则为主的工具规则形式和以通胀目标规则为主的非taylor目标规则形式。
进一步，在完全时间一致性标准下，本书还着重探讨了基准lre模型、考虑通胀惯性的lre模型和考虑流动性过剩的lre模型，分析了不同情形下的完全时间一致性工具规则和完全时间一致性目标规则及其最优外在特征。

《完全时间一致性、确定性与稳健最优利率规则-基于lre模型的分析与扩展》的主要对象是金融学及其相关专业的硕士研究生、博士研究生，同时本书也适用于高等院校、科研院所的教师和科研人员阅读。
《完全时间一致性、确定性与稳健最优利率规则-基于lre模型的分析与扩展》可以作为具备一般经济学基础，且需继续学习高级货币经济学的读者的先行教材，是阅读国外前沿文献、追踪货币经济学研究动态的必备参考书。

书籍目录

前言
第1章 导 言
1.1 研究意义
1.2 利率规则理论发展的逻辑性分析
1.3 最优利率规则理论的提出及其核心理论命题
1.4 基本思路和结构安排
第2章 利率规则理论综述
2.1 利率与非政策经济变量：事实与经验
2.1.1 向量自回归模型与结构向量自回归模型
2.1.2 利率与非政策经济变量的短期关系
2.1.3 对向量自回归模型与结构向量自回归模型的简要评价
2.2 一般均衡模型中的利率规则
2.2.1 有限信息模型诊断策略
2.2.2三个基本模型
2.2.3 对三个基本模型的比较
2.3 利率规则与均衡的确定性
2.3.1 taylor规则及其变形
2.3.2 taylor规则与均衡的确定性
2.4 政策评价
2.4.1 一个用于评价利率规则的简单模型
2.4.2 最优利率规则及其评价准则
2.5 小结
第3章 最优利率规则的界定标准
3.1 完全时间一致性标准
3.1.1 全局最优解、条件承诺最优解与相机抉择最优解
3.1.2 时间一致性政策
3.1.3 时间一致性最优解与相机抉择最优解——无穷远视角的观点
3.1.4 无穷远视角下的完全时间一致性最优解
3.2 确定性标准
3.2.1 最小状态变量法(msv)与带预期算子的差分系统
3.2.2 差分系统与确定性
3.3 稳健性标准
3.3.1 规则形式、外生随机扰动与稳健性
3.3.2 完全时间一致性稳健工具规则与完全时间一致性稳健目标规则的等价性
第4章 完全时间一致性标准下最优利率规则的一般线性理性预期(lre)模型
4.1 一般线性理性预期模型的回顾与改进
4.1.1 目标函数、经济约束条件与完全时间一致性约束条件
4.1.2 前提假设
4.1.3 最优理性预期均衡的完全时间一致性动态特征
4.1.4 拉格朗日乘子的完全时间一致性均衡路径
4.2 一般线性理性预期模型的完全时间一致性稳健最优利率规则
4.2.1 完全时间一致性稳健最优工具规则
4.2.2 完全时间一致性稳健最优目标规则
第5章 完全时间一致性标准下最优利率规则的基准lre模型及其扩展
5.1 基准lre模型的回顾与改进

5.1.1 目标函数、经济约束条件与完全时间一致性约束条件
5.1.2 完全时间一致性稳健最优工具规则
5.1.3 完全时间一致性稳健最优目标规则
5.2 考虑通胀惯性的lre模型的回顾与改进
5.2.1 目标函数、经济约束条件与完全时间一致性约束条件
5.2.2 完全时间一致性稳健最优工具规则
5.2.3 完全时间一致性稳健最优目标规则
5.3 考虑流动性过剩的lre模型
5.3.1 流动性过剩、利率期限结构与货币政策——一个定性分析框架
5.3.2 完全时间一致性标准与流动性过剩双重约束下的lre模型
5.3.3 流动性过剩均衡确定性条件
5.3.4 稳健最优利率规则
附录
第6章 结论
参考文献

章节摘录

其次，《新帕尔格雷夫货币与金融学词典》从更加宏观的角度将流动性定义为货币供给与产出之比，这一定义与中国人民银行提出的宏观流动性的概念相一致，只是比率的概念使流动性成为一个数量化指标，相应地，该比率指标越高。
流动性越强；该比率指标越低，流动性越弱。
这一界定的经济学基础是将流动性视为产出的“润滑剂”，流动性的强或弱将会直接促进或抑制产出的扩张，因而它并没有超越货币的定义，也没有超越金融相关比率指标（戈德史密斯（1994））和金融深化指标（麦金农（1997）、肖（1998））的含义，它与剑桥方程式中的马歇尔K值和费雪方程式中的货币流通速度v的倒数的含义是一致的，或者说，这一定义为货币与产出的关系从流动性的角度提供了一种新的解释。
这一定义有其利弊，它将高度抽象的流动性概念简易化，从而经济学家和投资者在实际使用流动性的概念时，可以笼统地将其理解为不同统计口径的货币和资金总量.这就增强了政策制定者、经济学家、公众对流动性概念的掌握、理解和共识，因而也就便利了货币当局在实施货币政策时与金融中介和公众之间关于流动性方面的信息沟通，有利于货币政策效果的实现；而且，这一定义将流动性概念指标化、数量化，而且各层次货币供应量和产出的数据易得，这就使流动性概念很容易被用以实际应用和分析，也就很可能得出一些与流动性相关的结论和政策含义。
然而，这样简单地定义整个经济体的流动性可能存在以下两个方面的问题（彭兴韵，2007）：一是一国货币统计口径不同会产生不同的流动性，而在某一个时点，作为一种状态的流动性应当是唯一的；二是代理人很容易将流动性视为货币供给，因而认为流动性过剩等同于超额货币供给，流动性不足等同于货币供给不足。

第一图书网, tushu007.com
<<完全时间一致性、确定性与稳健最优 >

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