第一图书网, tushu007.com

<<动态经济学方法>>

图书基本信息

书名：<<动态经济学方法>>

13位ISBN编号：9787301196335

10位ISBN编号：7301196334

出版时间：2002-7

出版时间：北京大学出版社

作者：龚六堂

页数：375

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

动态经济学方法对于一个立志进行经济学、金融学研究的人来讲是至关重要的，国外很多著名大学的经济学系、商学院都要为研究生开设这方面的课程。
《普通高等教育“十一五”国家级规划教材：动态经济学方法（第2版）》系统地介绍了动态经济学的方法。
以使读者对动态经济学方法有一个更深的了解，让读者熟知动态经济学方法的应用。

《普通高等教育“十一五”国家级规划教材：动态经济学方法（第2版）》由三部分构成。
考虑到动态经济学模型更多地以离散时间模型的形式出现，我们将离散时间问题的处理方法放在了第一部分：将连续时间问题的处理方法放在了第二部分；考虑到读者对一些基础知识，如凸集合和凸函数以及Lagrange方法已经比较熟悉了，我们把这部分内容作为预备知识放在了第三部分。

本书给出了大量的经济学模型，如Ramsey模型、Sidrauski模型、OLG模型、投资模型等，这些都是经济学中非常重要的、基本的模型。
我们还给出了一些数值计算方法以及经济学应用方面的例子，如在第二章给出了动态经济学问题中经常用到的Kalman滤波方法；在第七章作为离散时间方法的应用，给出了离散选择问题；在第十一章给出了连续时间数值方法、有限差分方法、微扰法以及投影法。
考虑到计算机的大量应用，并且大量的经济学问题不能通过解析方法得到解析解，我们在书中也适当兼顾了Matlab的应用，给出了计算程序。

本书可以作为高年级本科生和研究生的优化方法、数理经济学和动态经济学方法等课程的教材，也可以作为研究动态经济学的参考书。

作者简介

龚六堂，北京大学光华管理学院教授、博士生导师，国家杰出青年基金获得者，2004年入选教育部首届“新世纪优秀人才”。

主要从事宏观经济管理、公共财政、动态经济学以及中国经济等相关方面的研究工作。在国际主流经济学刊物（Journal of Money， Credit， and Banking、Journal of Economic Dynam-ics and Control、Macroeconomic Dynamics等）和国内重要学术刊物（《经济研究》、《中国社会科学》、《管理世界》等）发表论文130余篇，研究成果先后获得教育部“科学技术进步奖”；北京市人文社会科学优秀成果一等奖、二等奖；第九届霍英东基金会全国高校青年教师奖（研究类）一等奖；第四届中国人文社会科学优秀成果奖等。

曾主持国家教育部人文社会科学“十五”规划项目、国家社会科学基金项目、国家自然科学基金委面上项目、国家自然科学基金委杰出青年基金项目以及香港研究基金会项目等。

苗建军，美国波士顿大学经济系副教授。1992年6月毕业于中国科技大学，获数学学士学位；1995年6月获中山大学经济学硕士学位；1998年6月获加拿大皇后大学金融学硕士学位；2003年5月获美国罗彻斯特大学经济学博士学位。

研究领域集中在金融与宏观经济学以及它们之间的交互机制与决策理论，此外还涉及产业组织理论、公共财政等领域。研究成果集中于投融资决策及公司动态、不完全市场中的动态一般均衡模型、资产定价和市场微观结构等方面，并在非标准的偏好理论的应用方面进行了探索性研究。在American Economic Journal：Macroeconomics. Economic Theory、Journal of Economic Theory. Journal of Financial Economics. Journal of Finance等国际权威杂志上公开发表学术论文多篇。

同时为美国经济学会、美国金融学会及计量经济学会成员。

书籍目录

第一部分 离散时间情形
第一章 确定性下的差分方程
第一节 一维一阶线性差分方程
第二节 一维二阶线性差分方程
第三节 高维一阶线性差分方程组
第四节 非线性动态系统
习题
第二章 随机线性差分方程
第一节 一阶随机线性差分方程组
第二节 线性理性预期模型
第三节 Kalman滤波
习题
第三章 确定性下的动态规划
第一节 压缩映射的不动点性质
第二节 最优化原理
第三节 值函数的性质
第四节 动态特征
习题
第四章 不确定性下的动态规划
第一节 最优化原理
第二节 值函数的性质
第三节 Euler方程
习题
第五章 线性二次规划
第一节 确定性下的线性二次规划问题
第二节 随机线性二次规划问题
第三节 线性二次逼近问题
习题
第六章 数值方法
第一节 介绍
第二节 动态规划的常用算法
第三节 求解Bellman方程的例子
附录 Matlab程序
习题
第七章 应用
第一节 离散时间的Ramsey模型
第二节 投资储蓄问题
第三节 消费理论
第四节 资产定价理论
第五节 Stockman模型
第六节 离散选择问题
习题
第二部分 连续时间情形
第八章 微分方程动力系统
第一节 可求解的微分方程

第二节 微分方程的稳定性
习题
第九章 确定性下的最优控制和动态规划
第一节 自由端点问题
……
第三部分 数学附录
参考文献

章节摘录

版权页：插图：他假设投资的回报具有不确定性，同时各时间之间的回报是独立、同分布的，消费者的目的就是选择消费水平和投资来极大化他的期望效用，他首先讨论了有限时间期限的模型，然后把时间趋近无穷大得到了无穷限的模型，在效用函数的边际效用弹性是常数时，他证明了如果边际效用的弹性的绝对值超过1，对于给定的财富水平，风险的增加会降低消费者的消费水平；如果边际效用的弹性的绝对值小于1，对于给定的财富水平，风险的增加会提高消费者的消费水平；如果边际效用的弹性的绝对值等于1，对于给定的财富水平，风险的改变不影响消费者的决策。
这里采用Phelps的框架，讨论无穷限的最优投资和储蓄行为，得到最优路径的必要条件和充分条件，这里把效用函数推广到——般的严格凹的效用函数，不仅仅限于常数弹性的效用函数；同时证明了在常数弹性的效用函数下，极限最优决策实际上是无穷限的最优决策，得到的充分条件类似于Mirrlees得到的一般情形下的连续时间的模型，这里采用的方法更简单，但得到的结论更具有一般性。

编辑推荐

第一图书网, tushu007.com

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