

<<基于机构部门账户的中国宏观 >

图书基本信息

书名：<<基于机构部门账户的中国宏观经济模型研究>>

13位ISBN编号：9787505865181

10位ISBN编号：7505865188

出版时间：2007-7

出版时间：经济科学出版社

作者：刘成杰

页数：245

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

建立宏观经济模型是研究宏观经济问题的基本方法之一。

经济系统中的各个部分在一定的外部条件下相互协调、相互制约，从而可以达到系统的既定目标。

探讨经济系统的总量特征——国民收入(或国内生产总值)、消费、投资、储蓄、进出口、就业、通货膨胀等以及定性定量地描述它们之间变动的一般关系，形成了宏观经济学的基本架构，也形成了彼此有别的学术流派。

依据经济思想流派的理论，将这些数量依存关系的概貌作系统性描述，组成一个数学系统并求解它，以此找到影响并达到系统目标的途径或方法，就是宏观经济模型。

本书以现代宏观经济理论(主要是凯恩斯理论)为指导，紧密结合中国经济实际，吸收国内外已有建模经验，建立了一个“基于机构部门账户的中国宏观经济模型”(China's Macro-economic Model Based on Institutional Accounts, 简称IAM)。

该模型使用资金流量核算成果为核算框架，合理融入其他宏观经济变量，用赛德尔迭代(Seidel iteration)算法求解，共有时间序列变量271个(不含时间趋势变量)，其中内生变量179个；外生变量92个，是一个以需求为主导的宏观经济计量模型。

应用IAM模型进行了预测和政策试验，以分析宏观经济政策对我国宏观经济总量及机构部门账户变量的影响，并得出了相关结论。

本书的主要部分包含：(1)建立与IAM模型相适应的数据库。

资金流量核算以收入分配和资金运动为核算对象，反映一定时期各机构部门收入的形成、分配、使用、资金的筹集和运用以及各机构部门间资金流入和流出情况(资金融通)。

资金流量核算的参与部门是机构部门，核算的成果反映在机构部门账户(即资金流量表，简称“FOF”)中。

由于IAM模型框架所用数据必须是FOF中项目的时间序列数据，而FOF是按年度连续发布的，必须把这些截面数据拆分成时间序列数据，这些数据和模型用到的其他时间序列一并做成数据库，才能被模型的运算程序提取使用。

本部分还对FOF中项目的含义、层次及核算内容进行了说明；对于数据库中的其他时间序列也列出了时期跨度和来源。

IAM数据库中共装有652个时间序列变量。

(2)阐明IAM的运行机理。

本部分首先对资金流量表的核算原理进行了详细说明，从中整理出IAM模型的核算结构，在此基础上把资金流量表(FOF)中的项目重新安排，使每个部门的资金流程变为闭合循环，以再现现实经济运行。

由此指定IAM的计算逻辑。

(3)构建IAM模型的方程体系。

本部分首先对建立IAM模型所用的建模软件作了简要介绍，方程体系中的变量关系由以下三种方式构建：恒等式、行为比率和行为方程。

恒等式来自资金流量表中的核算关系；行为方程共23个，由回归方式给出；IAM用一部分“行为比率”建立关系较紧密变量之间的关系。

(4)用IAM模型进行历史模拟和反历史模拟。

该部分的作用主要是对模型进行检验。

(5)用IAM进行预测和政策试验。

预测分为三个有机组成部分：2004～2006年中国经济发展的回顾；2007—2010年的展望；外生变量准备；预测结果。

政策试验部分作者设计了“放松”、“适度”和“紧缩”三种宏观经济政策方案(主要指三种不同的货币政策和财政政策组合)进行事前模拟，并比较不同政策方案的结果。

通过预测和政策试验得出了以下结论：(1)如果货币M1持续快速(超过17%)增长，会破坏中国经济发展的稳定性，经济会出现较大的波动。

(2)2006年是一个关键年，我国在该年份的宏观经济政策是成功的，从IAM模型机制来看，如果2006年全年执行了紧缩的宏观经济政策，以后的经济增长会出现较大的滑落。

(3)如果我国继续执行适当的(指政策试验中的“适度”方案)宏观经济政策，积极促进经济结构调整，在目前的国际国内大背景下，我国经济持续快速发展一个时期，是完全可能的。

IAM模型具有以下三个方面创新：(1)首次全面采用中国机构部门账户提供的数据为核算框架，构建中国宏观经济计量模型，使该模型除了能分析宏观总量外，还具备分析机构部门账户变量的功能，以此推动相关理论问题的研究，拓宽我国资金流量核算数据的应用领域。

(2)IAM模型具备反历史模拟功能。即可以改变外生变量的历史值，重新运行模型，这种“事后模拟”和预测与政策试验的“事前模拟”相互补充，有助于更好地把握宏观经济政策的影响。

(3)把资金流量表(实物交易1992—2003年)、资金流量表(金融交易1992—2003年)和国际收支平衡表(1985~2005年)中项目(变量)的截面数据拆分为时间序列数据，连同其他宏观经济变量，做成IAM数据库。

作者简介

刘成杰

男，河北工业大学副教授，中央财经大学统计学院数量经济学专业博士。
主要研究领域为宏观经济模型、收入分配、税收统计分析、公共政策分析等。

书籍目录

第1章 引言 1.1 选题的理论意义及实践意义 1.2 研究方案第2章宏观经济模型发展与研究现状 2.1 建立宏观经济模型的理论发展 2.2 国民经济核算数据是宏观经济模型的基础 2.3 宏观经济计量模型在国外的发展 2.4 中国宏观经济计量模型的发展和问题第3章 IAM模型数据库 3.1 资金流量表中的变量与命名 3.2 数据库中存放的其他时间序列第4章 IAM模型的运行机理 4.1 中国资金流量表的运行机理 4.2 资金流量表的资金循环和IAM的计算逻辑第5章 IAM模型方程体系构建 5.1 建立模型所用的软件 5.2 IAM模型的恒等式和行为比率 5.3 IAM的行为方程第6章 历史模拟与反历史模拟 6.1 历史模拟 6.2反历史模拟 6.3 我国历年总折旧的估算第7章 用IAM进行预测 7.1 2004—2010年我国经济总体走势分析 7.2 外生变量准备 7.3 预测结果第8章 政策试验附录1 IAM模型的Master文件附录2 机构部门账户变量动态历史模拟结果附录3 机构部门账户变量动态反历史模拟结果附录4 机构部门账户变量预测结果附录5 三种不同政策组合对机构部门变量影响的模拟结果比较主要参考文献后记

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>