



中级宏观经济学 (拔尖班) 笔记

2024-2025 学年秋冬学期

作者: Yishu Jiang

组织: School of Economics, Zhejiang University

时间: September 20, 2024



Talk is cheap, show me your solution!

前言

本笔记是 2024-2025 学年秋冬学期面向经济学拔尖班开设的中级宏观经济学的学习笔记, 主要使用的教材为何樟勇《高级宏观经济学》和卢卡斯的《经济动态的递归方法》.

由于本人初次学习概率论且水平能力有限, 笔记中有所疏漏处, 恳请指正.

目录

第一部分 中宏的简单模型	1
第 1 章 单期代表性行为人模型	2
1.1 决策环境: 偏好、禀赋与技术	2
1.1.1 基本环境	2
1.1.2 偏好	2
第 2 章 两期动态模型	3
第 3 章 三期动态模型	4
第 4 章 无穷期动态模型	5
第二部分 数学工具	6
第 5 章 动态规划 Dynamic Programing	7
第 6 章 基本的数值计算方法	8
第三部分 DEGE: 动态随机一般均衡	9
第 7 章 真实经济周期模型 RBC	10
第 8 章 Banking Model	11
第 9 章 金融摩擦	12

第一部分

中宏的简单模型

第 1 章 单期代表性行为人模型

本章介绍最简单的宏观经济模型, 在这个模型中, 抽象掉**异质性和分配问题** (例如禀赋、偏好等都是同质的, 在去掉异质性后事实上就不存在分配问题了). 假定经济由一个代表性的企业和一个代表性的消费者组成 (这和有許多本质相同的企业和許多本质相同的消费者所组成的经济是相同的).

基本的分析思路是: 首先关注行为人在约束条件下的最优化问题, 然后分析不同行为人的自利行为交互会产生怎样的效果. 首先我们需要知道消费者的偏好, 企业的生产技术以及消费者与企业的资源禀赋.

1.1 决策环境: 偏好、禀赋与技术

1.1.1 基本环境

1. 经济活动只进行**一期**
2. 经济中只有一个代表性消费者和一个代表性企业
3. 代表性消费者决定最优的资本供给和劳动供给; 代表性企业决定最优的资本和劳动使用量
4. 消费者和企业的行为都是**竞争性的** (价格外生给定)
5. 消费者拥有企业

1.1.2 偏好

我们用效用函数来表示消费者的偏好:

$$u(c, l)$$

其中 c 表示消费, l 是闲暇. 两者之间存在一个替代作用: 每天的时间是固定的, 闲暇时间越长, 劳动时间越短, 收入就越少, 消费也就越少, 反之同理. 效用函数满足以下假设:

1. 严格凹、二次可微——边际效用递减;
2. 严格增—— $u(\cdot)$ 对 c 和 l 增;
3. Inada 条件: $\frac{\partial u}{\partial c}(0, \cdot) = +\infty$, $\frac{\partial u}{\partial l}$

第 2 章 两期动态模型

第 3 章 三期动态模型

第 4 章 无穷期动态模型

第二部分

数学工具

第 5 章 动态规划 Dynamic Programing

第 6 章 基本的数值计算方法

第三部分

DEGE: 动态随机一般均衡

第 7 章 真实经济周期模型 RBC

第 8 章 Banking Model

第 9 章 金融摩擦