

NEW IS-LM ノート続々

まとめ

資料の誤りがあったので、以下のように訂正します。指摘してくれた人、有難うございます。もとのノートに従って課題4をやった人については、もちろん減点しません。

$$\begin{cases} y_t = E_t y_{t+1} - \sigma \cdot (i_t - E_t \pi_{t+1}) & \sigma \equiv \frac{1}{\theta} & (IS) \\ \pi_t = E_t \pi_{t+1} + \alpha \cdot y_t & \alpha \equiv \frac{\rho^2(\lambda + \theta)}{1 - \rho} & (AS) \end{cases}$$

金利ルール $i_t = \rho_1 y_t + \rho_2 \pi_t + \zeta_t$, $\zeta_{t+1} = \phi \cdot \zeta_t + \varepsilon_{t+1}$
 or

マネーサプライルール $\begin{cases} \Delta M_{t+1} = \phi \Delta M_t + \varepsilon_{t+1} \\ m_{t+1} - m_t = \Delta M_{t+1} - \pi_{t+1} \\ m_t = -\frac{1}{\mu} i_t + \frac{\theta}{\mu} y_t \end{cases}$ (貨幣需要)

金利ルールの下での均衡

$$\begin{bmatrix} 1 & \sigma & 0 \\ 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} E_t y_{t+1} \\ E_t \pi_{t+1} \\ E_t \zeta_{t+1} \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 1 + \sigma \rho_1 & \sigma \rho_2 & \sigma \phi \\ -\alpha & 1 & 0 \\ 0 & 0 & \phi \end{bmatrix} \begin{bmatrix} y_t \\ \pi_t \\ \zeta_t \end{bmatrix}$$

ここでは不要でした。正しくは単にです。訂正します。

マネーサプライルールの下での均衡

$$\begin{bmatrix} 1 & \sigma & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 1 & -1 \\ 0 & 0 & 0 & 1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} E_t y_{t+1} \\ E_t \pi_{t+1} \\ E_t m_{t+1} \\ \Delta E_t M_{t+1} \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 2 & 0 & -\mu \sigma & 0 \\ -\alpha & 1 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & \phi \end{bmatrix} \begin{bmatrix} y_t \\ \pi_t \\ m_t \\ \Delta M_t \end{bmatrix} \quad (R76)$$