

我國自然失業率的估計:非對稱性模型之實證應用

李春山、林福來博士

E-mail: 9403203@mail.dyu.edu.tw

摘要

根據行政院主計處統計資料顯示，我國近十年來失業率逐漸攀升並已達到近三十年之高峰，同時經濟成長率首度呈現負成長，顯示我國經濟結構產生了重大改變，導致失業率維持在歷年之高峰狀態，故此議題為不容忽視之研究議題。在此，本論文利用Lilien(1982)的部門移轉假說建立失業率之理論模型，並採用門檻迴歸模型建構出非對稱性的失業率實證模型，藉以捕捉出我國失業率及自然失業率之波動情況。相較之下，現存文獻多以線性模型或未運用經濟模型估計失業率情況，則無法說明面對不同的經濟發展階段具有不同的預期現象，故本論文之模型設定更符合現實經濟社會的理性假定。實證結果發現，我國失業率在自然失業率水準上下波動，且隨時間改變而非固定值。估計結果並顯示，我國失業率於近期仍處於高峰期，雖已見緩和和下降之趨勢；然而，自然失業率卻仍然呈現上昇之趨勢。

關鍵詞：失業率；自然失業率；部門移轉假說；門檻迴歸模型

目錄

目錄	i 圖目錄	? 表目錄	? 中文摘要	? 英文摘要
	? 誌謝	? 第一章 緒論	1 1.1 研究背景與動機	
1 1.2 研究目的		3 1.3 本文研究步驟與架構	5 第二章 文獻探討	6 2.1
失業之定義與分類		6 2.1.1 失業之定義	6 2.1.2 失業之分類	
6 2.1.3 自然失業率的定義		7 2.2 自然失業率相關文獻	8 2.2.1 我國經濟結構與勞動力結構變遷	
分析 8 2.2.2 自然失業率研究現況		10 2.2.3 非對稱性時間序列模型介紹與運用	12 第三章 理論與實證模型	
15 3.1 部門移轉假說理論模型		15 3.2 TAR模型	18 3.3 本文的實證研究	
模型	19 第四章 我國自然失業率估計之實證結果	22 4.1 資料來源	22 4.2 我國失業率實證	
結果	29 4.2.1 Regime 1	31 4.2.2 Regime 2	33 4.2.3 綜合我國實證結果	
34 4.3 我國自然失業率之估計	36 第五章 結論	39 參考文獻	41	

參考文獻

- 一、中文部分: 1.王銘正和方振瑞(2003),「大陸興起對台灣產業結構與失業率之衝擊」,第七屆經濟發展學術研討會-當前失業問題探討,5月。2.李誠(2000),「台灣非自願性失業在就業問題」,台灣的失業問題,頁69-98。3.李建強(2003),「金融發展、經濟成長與資本所得稅」,中正大學國際經濟研究所博士論文。4.林聖銘(2002),「台灣地區失業問題之研究?部門移轉假說之驗證」,中央大學產業經濟研究所碩士論文。5.林慈芳(2002),「自然失業率之分析與對策」,自由中國之工業,第92卷第六期,頁111-126。6.邱秋瑩(2002),「當前台灣失業率攀升之分析與對策」,自由中國之工業,第92卷第六期,頁3-41。7.許永河(1998)「台灣地區自然失業率之估計」,成功大學學報第三十三卷,頁125-158。8.馬舜智(1989),「循環性失業之研究?部門移轉假說之理論與實際」,逢甲大學經濟研究所碩士論文。9.張清溪和宋皇叡(2000),「失業對產業結構轉變的影響」,台灣的失業問題,頁99-137。10.黃仁德(1994),「台灣地區失業類型與結構性失業的探討」,勞動學報,頁118-121。11.陳仕偉和沈中華(2003),「台灣景氣循環持續依存特性之探討」,台灣經濟預測與政策,第34卷第1期,頁63-92。12.彭惠琴(2002),「通貨膨脹、就業及貨幣政策與景氣循環之關聯性」,中原大學國際貿易學系碩士學位論文。13.楊曉姍(2002),「利用馬可夫轉換模型研究台灣失業率的不對稱性」,台灣大學經濟研究所碩士論文。14.趙弘靜(1997),「當前失業問題與因應政策?淺談自然失業率與結構性失業」,台灣經濟金融月刊,第38卷第6期,頁33-53。15.劉克智和董安琪(2001),「台灣勞動市場與失業問題」,自由中國之工業,第91(4)期,頁1-40。16.饒秀華和林修葺、黎明淵(2001),「藉由分期MS模型分析台灣經濟景氣狀態」,中央研究院經濟論文叢刊第29期,頁297-319。二、英文部分 1.Barro,R.J.(1977),“Unanticipated Money Growth and Unemployment in the United States”,The American economic Rivew,Vol.67:2,101-115。2.Fridman,M.(1968),“The Role of Monetary Policy”,The American economic Rivew, Vol.58, 1-17。3. Lilien, D.M.(1982),“Sectoral Shifts and Cyclical Unemployment”,Journal of Political Economy, Vol.90, 777-794 4.Phelps,E.(1967),“Expectations of inflation and optimal unemployment over time”,Economica,Vol.34,254-281 5.Rothman,P.(1998),“Forecasting asymmetric unemployment rates”,Review of Economics and Statistics, Vol.80, 164-168。6.Tong,H.(1983),“Threshold Models in Non-Linear Time Series Analysis”,Springer Verlag.New York。