

Estimation of the Natural Rate of Unemployment in Taiwan: Application of the Asymmetric Model

李春山、林福來博士

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

ABSTRACT

According to Manpower Survey data of National Statistics of Taiwan, the rate of unemployment has been gradually rising in our country and reached the peak in the past 30 years. At the same time, the economic growth rate first has been falling. These show that the economic structure of our country has been changed greatly. This causes the rate of unemployment to maintain the peak state over the years, so the topic can not be ignored. This thesis utilizes Lilien (1982)'s sectoral shift hypothesis to build the theoretical model and adopt the threshold regression model to capture the asymmetric fluctuation situations of rate of unemployment and natural rate of unemployment. Compared with the existing literatures, they either used the linear model or not used the economic model to estimate the rate of unemployment; the asymmetric model corresponds with the real society of economics. Empirical results show that the rate of unemployment fluctuates around the natural rate of unemployment level, and the natural rate of unemployment is time-varying. Moreover, the rate of unemployment of our country will be still in peak period but with the slowly declining trend. However, the natural rate of unemployment still presents the trend of rising.

Keywords : rate of unemployment ; natural rate of unemployment ; sectoral shift hypothesis ; threshold regression model

Table of Contents

目錄	i 圖目錄	ii 表目錄	iii 中文摘要	iv 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 2.1.3 自然失業率的定義	7 2.2 自然失業率相關文獻	6 2.1.2 失業之分類	
6 2.1.3 自然失業率的定義		10 2.2.3 非對稱性時間序列模型介紹與運用	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	15 3.1 部門移轉假說理論模型	15 3.2 TAR模型	12 第三章 理論與實證模型	
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	18 3.3 本文的實證研究	
結果	29 4.2.1 Regime 1	31 4.2.2 Regime 2	22 4.2 我國失業率實證	
34 4.3 我國自然失業率之估計	36 第五章 結論	39 參考文獻	33 4.2.3 綜合我國實證結果	
			41	

REFERENCES

- 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.