

XINBIAN JINGJIXUE

新编经济学教程系列

JIAOCHENG XILIE

现代经济学

(宏观经济学部分)

孙斌艺 编著

Xiandai Jingjixue
(Hongguan Jingjixue Bufen)

立信会计出版社

新编经济学教程系列

现代经济学

(宏观经济学部分)

孙斌艺 编著

立信会计出版社

图书在版编目(CIP)数据

现代经济学·宏观经济学部分/孙斌艺编著. —上海:立信会计出版社,2005.6

(新编经济学教程系列)

ISBN 7-5429-1469-3

I. 现… II. 孙… III. ① 经济学-教材 ② 宏观经济学-教材 IV. F0

中国版本图书馆 CIP 数据核字(2005)第 065242 号

出版发行	立信会计出版社
经 销	各地新华书店
电 话	(021)64695050×215 (021)64391885(传真) (021)64388409
地 址	上海市中山西路 2230 号
邮 编	200235
网 址	www.lixinaiph.com
E-mail	lxaph@sh163.net
E-mail	lxzbs@sh163.net (总编室)

印 刷	立信会计常熟市印刷联营厂
开 本	787×960 毫米 1/16
印 张	17.25
插 页	2
字 数	338 千字
版 次	2005 年 6 月第 1 版
印 次	2005 年 6 月第 1 次
印 数	3 000
书 号	ISBN 7-5429-1469-3/F·1324
定 价	26.50 元

如有印订差错 请与本社联系

前 言

记得一次学生举办活动采访我，问我为什么选择了学习和教授经济学。说起来，从一开始自己就没有什么远大的志向，也没有什么看上去还比较“崇高”的理想，充其量就是想在风雨滂沱之夜蜷缩在沙发上，读自己想读而一直未读的书。最初我感兴趣的学科是数学和天文学，曾经为寻找天空的星座跑到不受灯光污染的旷野，对照星图一一标出星座的位置，也曾为几个难解而有趣的数学问题而彻夜不眠。如果要找能够像读武侠小说一样读数学和天文学著作的人，我大概可以算上一个。之所以选择经济学的原因很简单，那就是因为自己读了经济学专业。起先我确实抱着应付的心态，不过，读着读着觉得经济学的味道越来越对自己的脾胃，恐怕其中与现代经济学愈益数学化有直接的关系。到目前为止，我的“行业偏见”也愈加严重，只觉得经济学是最迷人的学科，不好好钻研一番委实可惜。

不少学生说，正是听了我的经济学课才使他们越来越喜欢这门学问，也许这是学生当面奉承之语，自知也没有那么大的影响力。不过，我留给他们“存疑求真，既研究看得见的后果，也关注看不见的后果”的警句有着极大的价值，也是我在学习经济学过程中的体悟。这个基本观点来自法国经济学家巴斯夏，他是我原先最不喜欢的经济学家，而现在他的著作成了我案头必备之书，时习而时新。且引巴斯夏的名作《看得见的与看不见的》中的一大段话，就知此言不虚。巴斯夏写道：

“在经济领域，一个行动、一种习惯、一项制度或一部法律，可能会产生不止一种效果，而是会带来一系列后果。在这些后果中，有些是当时就能看到的，它在原因发生之后立刻就出现了，人们都能注意到它；而有些后果则得过一段时间才能表现出来，它们总是不被人注意到，……一个好经济学家与一个坏经济学家之间的区别就只有一点：坏经济学家仅仅局限于看到可以看得见的后果，而

好经济学家却能同时考虑可以看得见的后果和那些只能推测到的后果。这种区别可太大了,因为一般情况都是,当时的后果看起来很不错,而后续的结果却很糟糕,或者恰恰相反。于是,事情经常就是,坏经济学家总是为了追求一些当下的好处而不管随之而来的巨大的坏处,而好经济学家却宁愿冒当下的小小的不幸而追求未来的较大的收益。”^①

人们往往以巴斯夏的《经济和谐论》一书而对其大加抨击,实际上只是看到巴斯夏理论的表面之处,没有真正理解其理论的内在精髓。我们往往将某些在具体经济环境下得出的具体结论看作当然之事,没有深究其“背后的东西”,而这些背后的、隐含的东西常常又使我们陷入难于解决的两难境地,更困难的是对此我们通常并不自知。就宏观经济学来说,这种现象或问题比比皆是,凯恩斯主义理论的隐含前提在于我们对于经济现象了如指掌,我们可以取政策之利,而不会受到政策带来的消极后果的影响。事实上,我们对经济现象的理解可谓刚刚入门,所以仔细权衡政策之短期和长期效应、直接和间接效应才是正确的道路,也是学习宏观经济学应当严肃对待的。因此,如果要真正理解各种经济现象的直接和间接、短期和长期效果,就必须掌握现有的经济学基本理论,在此基础上深入观察,小心求证,才能使我们更好地理解经济社会的内在运作机理,行为处事也才能更加客观理性。

本书是现代经济学教材的其中一部,讲述的是宏观经济学,描述和分析似乎离我们生活很远,但又时时左右着我们的国民经济总体的宏观问题。为便于学生理解和学习,本书按照宏观经济学的基本逻辑体系进行写作。我个人将宏观经济学归纳为五个词、十个字,即“核算、决定、变动、问题和政策”。其中,“核算”是指国民收入核算,这部分内容可以视为宏观经济学的预备知识,主要说明衡量宏观经济总量的基本方法,以及各个经济总量之间的基本核算关系,这些内容构成了本书的第二章。“决定”是指国民收入决定,这是宏观经济学理论的核心部分,是分析各种宏观经济现象和问题的基本理论框架,主要由收入—支出模型、产品市场和货币市场同时均衡模型以及总需求和总供给模型构成。本书的第三章到第八章阐述这些理论模型。“变动”是指宏观经济

^① [法]弗里德里克·巴斯夏,秋风译:《财产、法律与政府——巴斯夏政治经济学文粹》,贵州人民出版社2003年1月第1版,第1~2页。

的短期波动和长期变动,短期波动研究经济周期问题,长期变动则研究经济增长问题,本书第十一章和第十二章对这些问题进行了分析。“问题”是指宏观经济中存在的两大经济病症,即通货膨胀和失业,这构成了本书的第九章。“政策”是指宏观经济政策,构成本书的第十章。可以毫不夸张地说宏观经济政策是经济学的落脚点,前面的分析都与它密切相关,是为政策运用提供理论支撑的。

本书写作中考虑到教师实际教学的需要。一般而言,教材难度较高时,教师比较容易取舍,可以根据学生的层次有选择地讲授某些内容。因此,本书采取了“就高”的写作定位,即整个难度比通常本科生教学要求高一些,不少地方运用了数学模型推导的方法,以期反映宏观经济学的一些前沿内容,教师在具体讲授过程中可以适当调整,删减一些难度较大的部分。此外,现代信息技术发展越来越快,网络中蕴藏着大量的宏观经济实际信息,教师可以结合相关章节内容,从网络上获取实际资料,将其运用到教学中,这样可以使学生能够更好地将理论与实践联系起来。

本书是我在十余年的教学工作的反映,写作中参考了国内外许多专著和教材,例如,复旦大学尹伯成教授主编的《现代西方经济学简明教程》、中国人民大学高鸿业教授主编的《西方经济学(宏观部分)》、美国多恩布什和费希尔的《宏观经济学》等,书后的参考文献列出了相关目录,在此深表谢意。

在本书写作期间,本人担任系里的一些行政工作,得到华东师范大学商学院众多同事的积极支持,如金润圭教授、黄泽民教授、兰发钦教授、黄焱副教授等,为我分担了不少工作,使本书能够如期完成。我还要感谢听我课的各个层次的学生们,在教学中他们提出了许多宝贵的意见,能够善意地对待我讲授过程中的错误。同样,我要对我的父母、岳父母表示感谢,尤其要感谢我的太太张丽君和儿子孙以宁,他们承担了繁重的家务,同时给我带来了许多快乐,我觉得家庭是我应对繁重工作的内在支撑。

最后,对立信会计出版社在出版工作中严格要求、对读者负责的态度表示诚挚的谢意,正是这种态度才使我少犯错误,也能够更好地接受读者的检验。同时对责任编辑周健临先生的出色工作表示由衷的钦佩,在我刚刚从教时还讲授过管理学原理,选用的就是周老师撰写的管理学教材,可以说周老师既是一位出色的作者,也是一位出色的编辑,工作中不放过任何一个细微的错误,

在此对他的辛勤工作表示由衷的谢意。

本书一定还存在许多错误,恳请读者多提宝贵意见,以便修订再版时改进,我的电子邮件地址是:bysun@dbm.ecnu.edu.cn。

孙斌艺

2005年6月

目 录

第一章 导论	1
学习目标	1
第一节 宏观经济学的涵义	1
一、宏观经济学的研究对象	1
二、宏观经济学的理论体系	2
第二节 宏观经济学的一些基本概念	5
一、国内生产总值	5
二、通货膨胀和通货紧缩	6
三、失业和失业率	8
第三节 学习和研究宏观经济学的意义	9
一、从微观到宏观	9
二、宏观经济学与个人职业生涯发展和企业经营管理	10
习题一	10
第二章 国民收入核算	12
学习目标	12
第一节 国内生产总值	12
一、国内生产总值的定义	12
二、名义 GDP 和实际 GDP	13
三、最终产品和中间产品	17
四、存量和流量	19
五、当前生产和销售	19
六、国内生产总值和国民生产总值	20
七、市场活动与非市场活动	21
八、国内生产总值指标存在的若干问题	21
第二节 国内生产总值核算的基本方法	21
一、总产出、总收入与总支出	21
二、收入法	23

三、支出法	25
第三节 国民经济中的其他主要经济总量指标	29
一、国民生产总值	29
二、国内生产净值	30
三、国民生产净值	30
四、国民收入	30
五、个人收入	30
六、个人可支配收入	31
第四节 国民收入核算中的恒等关系	32
一、两部门经济中的储蓄投资恒等式	32
二、三部门经济中的储蓄投资恒等式	33
三、四部门经济中的储蓄投资恒等式	33
习题二	34
第三章 消费和储蓄理论	36
学习目标	36
第一节 消费和消费函数	37
一、消费支出及其影响因素	37
二、消费函数	39
三、国民消费函数	42
第二节 储蓄和储蓄函数	43
一、储蓄函数	43
二、消费函数和储蓄函数的关系	45
第三节 现代消费理论及其发展	46
一、相对收入假说	47
二、持久收入假说	48
三、生命周期假说	49
习题三	51
第四章 投资理论	52
学习目标	52
第一节 概述	53
一、宏观经济学中的投资概念	53
二、决定投资的主要因素	56

第二节 资本边际效率与投资的决定	57
一、资本的未来收益贴现率与资产的现值	57
二、资本边际效率	61
三、投资函数	64
第三节 投资的加速原理	66
一、资本—产出比率	66
二、加速原理	67
第四节 固定资产投资和存货投资	69
一、固定资产投资的新古典模型	69
二、存货投资	71
习题四	72
第五章 国民收入决定的收入支出模型	74
学习目标	74
第一节 总需求与均衡产出或均衡收入	75
一、国民经济中的总需求	75
二、国民经济的均衡条件	76
第二节 两部门经济的收入支出模型	78
一、消费函数与均衡国民收入	78
二、投资、储蓄和均衡国民收入	79
三、两部门经济中均衡的比较静态分析	80
第三节 乘数理论	82
一、国民收入决定的动态分析	82
二、乘数的含义	84
三、乘数的数学推导和图解	84
第四节 三部门和四部门经济的收入支出模型	86
一、引入政府部门	86
二、三部门经济的收入支出模型	89
三、三部门经济中的乘数	91
四、四部门经济的收入支出模型	95
习题五	97
第六章 货币需求和货币供给	99
学习目标	99

第一节 货币的性质和发展·····	100
一、货币的性质·····	100
二、货币的发展·····	102
三、现代货币层次·····	103
第二节 银行体系与货币创造·····	107
一、银行体系·····	107
二、存款创造与货币供给·····	108
第三节 货币需求·····	112
一、货币需求和货币需求动机·····	112
二、影响货币需求的因素·····	113
三、货币需求函数·····	116
第四节 货币市场均衡·····	118
一、均衡利率的决定·····	118
二、均衡利率和均衡货币量的变动·····	119
习题六·····	121
第七章 扩展的凯恩斯宏观经济模型: IS—LM 模型 ·····	122
学习目标·····	122
第一节 产品市场均衡·····	123
一、产品市场均衡曲线的推导·····	123
二、IS 曲线的特征·····	126
三、产品市场的失衡·····	130
第二节 货币市场的均衡·····	132
一、货币市场均衡曲线的推导·····	132
二、LM 曲线的特征·····	134
三、货币市场的失衡·····	136
第三节 产品市场与货币市场的一般均衡·····	137
一、均衡利率和均衡收入的决定·····	137
二、市场均衡的比较静态分析·····	140
三、IS—LM 模型的政策含义·····	143
习题七·····	146
第八章 国民收入决定的 AD—AS 模型 ·····	147
学习目标·····	147

第一节 总需求曲线	148
一、总需求曲线的推导	148
二、总需求曲线的特征	152
第二节 总供给曲线	157
一、劳动市场均衡与总供给	157
二、总供给曲线的推导	161
三、凯恩斯主义总供给函数	164
四、古典学派总供给函数	166
第三节 总供求模型	167
一、古典学派总供求模型	167
二、凯恩斯主义总供求模型	168
三、总供求模型的政策含义	170
习题八	172
第九章 宏观经济的主要问题:通货膨胀和失业	174
学习目标	174
第一节 通货膨胀	175
一、通货膨胀的定义与衡量	175
二、通货膨胀的类型	180
三、通货膨胀的成因	182
四、通货膨胀的成本	187
五、通货膨胀的经济效应	188
六、通货膨胀的治理对策	191
第二节 失业及其对国民经济的影响	193
一、失业及其类型	193
二、失业的成本和奥肯定律	196
三、自然失业率及其决定因素	197
第三节 通货膨胀和失业的替代关系	198
一、菲利普斯曲线	198
二、预期和菲利普斯曲线	200
三、长期菲利普斯曲线	202
习题九	203
第十章 宏观经济政策的原理和运用	204

学习目标	204
第一节 财政政策	205
一、财政政策工具	205
二、自动稳定器	207
三、挤出效应	208
四、财政政策的限制	212
第二节 货币政策	214
一、货币政策工具	214
二、货币政策的传导机制	217
三、货币政策效果	218
四、货币政策的限制	219
习题十	220
第十一章 经济周期波动	222
学习目标	222
第一节 经济周期概述	223
一、经济周期的概念和阶段	223
二、经济周期的类型	225
第二节 经济周期的基本理论	227
一、经济周期理论的分类	227
二、单一因素周期理论	228
三、实业周期理论	229
四、储蓄投资过程周期理论	229
五、新古典主义周期理论	232
第三节 卡尔多经济周期模型	233
一、投资函数和储蓄函数的扩展分析	233
二、投资和储蓄的多重均衡	236
三、经济周期模型	237
第四节 乘数—加速数相互作用模型	239
一、模型框架	239
二、国民收入的动态变化	240
习题十一	242
第十二章 宏观经济的长期增长	244

学习目标	244
第一节 经济增长概述	246
一、经济增长和经济发展的概念	246
二、经济增长的主要因素	247
第二节 哈罗德—多马经济增长模型	249
一、模型框架	249
二、经济增长的动态路径	250
第三节 新古典增长模型	252
一、集约形态的总量生产函数	252
二、新古典增长模型的基本框架	253
三、储蓄率变动的的影响	256
四、劳动力增长率变动的的影响	257
五、资本的黄金律水平	257
六、技术进步对经济增长的影响	258
习题十二	260
参考文献	261

第一章 导 论

一群群人看似杂乱无章地散布各处,可从直升机上却是一幅美妙的图画,每个人都成为这幅图画的构成部分。单个人虽微不足道但却不可或缺,个体的独特与整体的和谐恰成对比。这就是宏观和微观之分野。

——题记

学 习 目 标

通过本章的学习,你应当能够:

1. 理解宏观经济学的研究对象及其与微观经济学的区别和联系;
2. 了解宏观经济学的基本理论框架;
3. 熟悉国内生产总值、通货膨胀、通货紧缩、失业和失业率等基本宏观经济学概念;
4. 了解学习和研究宏观经济学对个人职业生涯与企业经营管理的意义。

正如题记中描述的那样,宏观经济学(Macroeconomics)侧重于从经济整体的角度出发分析经济变量的决定与变化的问题。本章主要阐述宏观经济学的基本研究对象、逻辑框架和主要宏观经济问题,在此基础上说明学习和研究宏观经济学的意义。

第一节 宏观经济学的涵义

一、宏观经济学的研究对象

从字面上来看,所谓宏观就是“大而观之”、“总体上考察”的意思。经济学涉及在资源

稀缺的情况下如何有效地配置资源,作出资源使用的最佳决策。从微观上考察时,我们可以把考察重点放在一个典型的消费者或生产者身上,假定其他人的行为是给定^①的,不考虑或较少考虑消费者或生产者作为总体的影响。概言之,微观经济学考察资源总量给定条件下,这些资源如何被分配用于各种不同用途,研究一个经济社会生产什么产品、每种产品生产多少,以及它们的相对价格如何决定,单个消费者依什么原则决定自己的收入用于不同产品的数量,单个生产者按什么原则决定生产什么产品,等等。而宏观经济学的视角从单个消费者、单个生产者和单个市场转移到整个国民经济活动,将经济社会视为一个整体进行分析。如果下一个一般性定义,那么宏观经济学就是以国民经济的总体活动作为考察对象,研究各种总体经济变量的决定、变动及其相互关系,分析和解决就业、失业、通货膨胀、经济周期、经济增长、政府收支、国际收支等整体经济问题的经济学分支体系。

著名经济学家德恩伯格(T. Dernburg)在其《宏观经济学》中指出:“宏观经济学研究诸如总产量、总就业与失业、价格的总水平与变动率、经济增长等总体问题。宏观经济学家所提出的问题涉及广泛的总量——与单个居民户支出决策的决定因素相对的所有消费者支出的决定;什么决定了所有厂商共同的资本支出,而不是单个厂商建立一个新厂的决定;与某个人为什么失业相对,决定经济中总失业水平的是什麼。宏观经济学衡量整个经济活动;它分析宏观经济政策的决定;它预测未来的经济活动;并且力图提出旨在使预测与生产,就业与价格的目标值相一致的政策反应。”

由此可见,在某种程度上宏观经济学跳出了分析经济体系中单个细胞的“近视”框架,使经济学分析能够从全局上把握经济形势的发展变化,从而为政府采取相关的宏观经济政策提供了较为充分的理论基础。

二、宏观经济学的理论体系

不少学者认为宏观经济学体系庞杂,是由各类宏观经济模型堆积而成的模型集,缺乏一以贯之的理论逻辑。以新古典主义(理性预期学派,如卢卡斯、萨金特等人)为代表的许多学者致力于为宏观经济学提供理论基础,建立内在逻辑一致的经济体系。这也是当前宏观经济学研究的重点领域之一。不过,尽管对于当前主流宏观经济学的理论体系众说纷纭,还是可以概括出如下图 1.1 所示的基本理论逻辑体系。

^① “给定”一词应当从两个角度理解,其一是“不变”,即当一个经济主体作出相关决策时,其他行为主体不会作出因应对策。例如,当人们对苹果更加偏爱时,会增加对其的需求,这时并不考虑人们对苹果与其他水果间的相对偏好关系;其二是“行为方式确定”,即当一个经济主体的某种行为会引致其他行为主体确定的反应。微观经济学中古诺模型中的“产量假定”就是“行为方式确定”的例子。

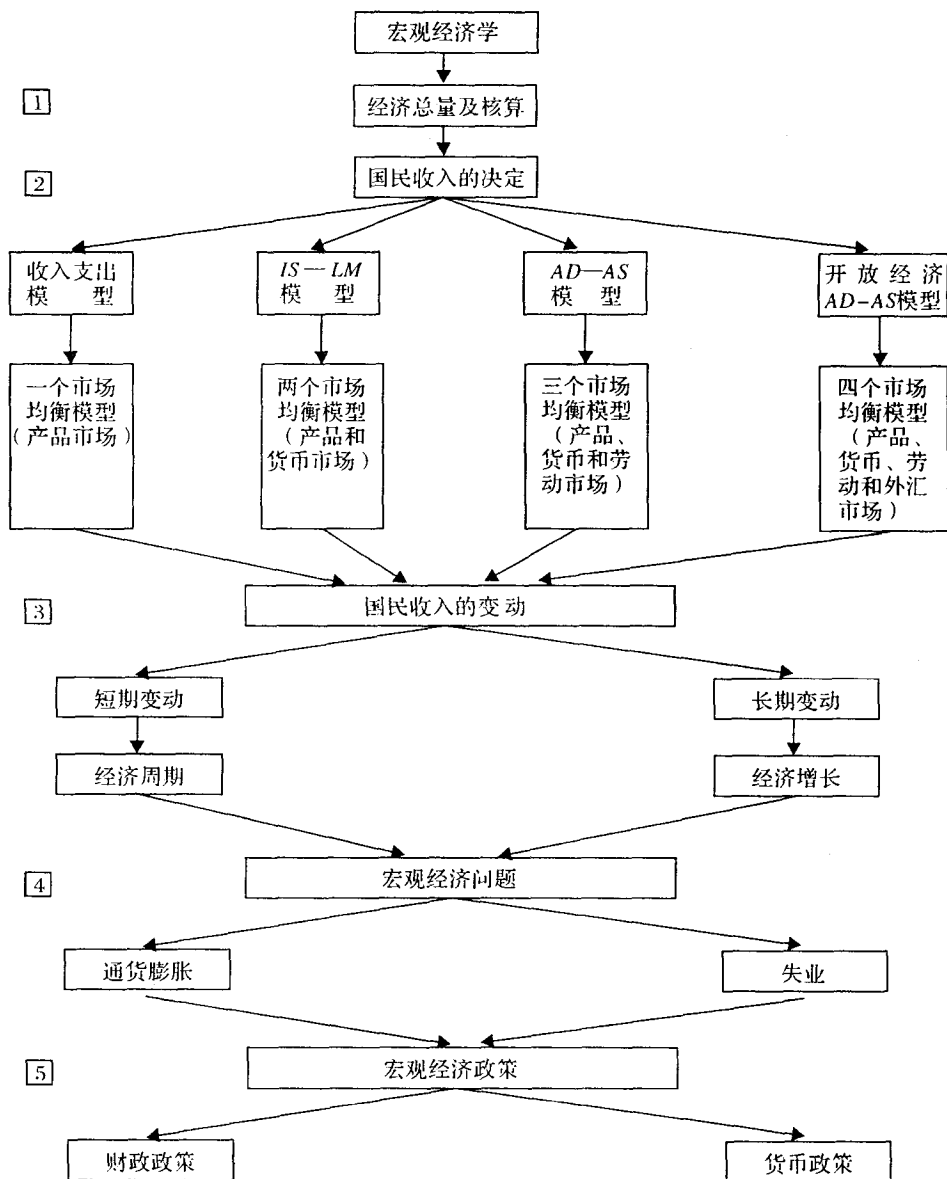


图 1.1 宏观经济学的理论体系

归纳而言,当前主流宏观经济学可以概括为五个大的方面,即国民经济核算、国民收入决定、国民收入变动、宏观经济问题和宏观经济政策。国民经济核算可以看作是宏观经济学的预备知识,主要是说明相关宏观经济总量,尤其是国内生产总值(Gross Domestic Product, GDP)是如何核算出来的,在宏观经济学研究中如何运用国民经济统计中获得的