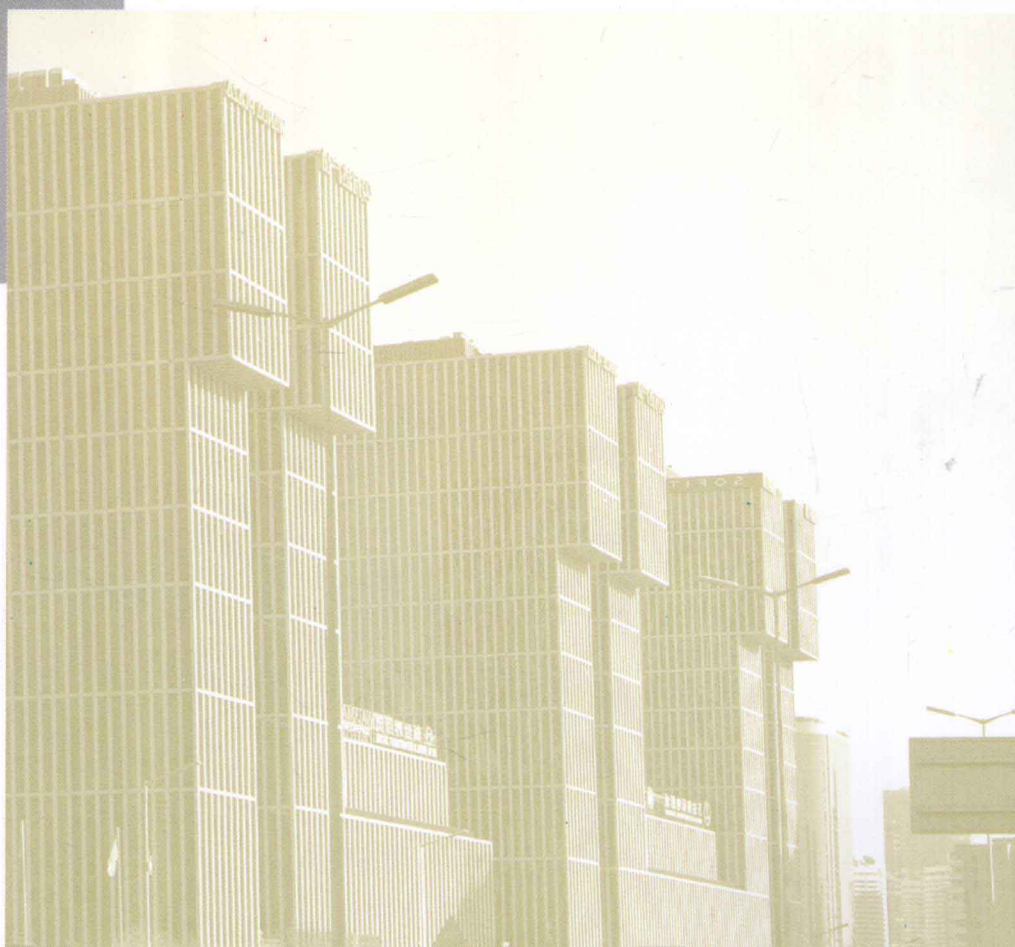


高等院校经济学管理学系列教材
GAODENG YUANXIAO JINGJIXUE GUANLIXUE XILIE JIAOCAI

中级宏观 经济学

ZHONGJI HONGGUAN JINGJIXUE

方显仓 编著



中级宏观 经济学

ZHONGJI HONGGUAN JINGJIXUE

方显仓 编著



北京大学出版社
PEKING UNIVERSITY PRESS

图书在版编目(CIP)数据

中级宏观经济学/方显仓编著. —北京:北京大学出版社, 2011. 9
(高等院校经济学管理学系列教材)

ISBN 978-7-301-16697-0

I. ①中… II. ①方… III. ①宏观经济学-研究生-教材 IV. ①F015

中国版本图书馆 CIP 数据核字(2010)第 248681 号

书 名: 中级宏观经济学

著作责任者: 方显仓 编著

责任编辑: 华 娜 王业龙

标准书号: ISBN 978-7-301-16697-0/F·2691

出版发行: 北京大学出版社

地 址: 北京市海淀区成府路 205 号 100871

网 址: <http://www.pup.cn>

电 话: 邮购部 62752015 发行部 62750672 编辑部 62752027

出版部 62754962

电子邮箱: law@pup.pku.edu.cn

印 刷 者: 河北滦县鑫华书刊印刷厂

经 销 者: 新华书店

730 毫米×980 毫米 16 开本 16.75 印张 310 千字

2011 年 9 月第 1 版 2011 年 9 月第 1 次印刷

定 价: 32.00 元

未经许可,不得以任何方式复制或抄袭本书之部分或全部内容。

版权所有,侵权必究

举报电话:010-62752024 电子邮箱: fd@pup.pku.edu.cn

前 言

笔者给研究生讲授“中级宏观经济学”课程已近十载。在教学的过程中,始终被两个问题困扰:一是如何区分“中级”与“高级”。给硕士研究生讲授“中级”,给人的感觉是,要比本科所学的“初级”教程深入,但又要比“高级”教程容易,使研究生在初级经济学的基础上更上层楼。但市面上已有的所谓中级教程要么是“高级”版的压缩,要么是“初级”版的放大。二是如何讲好中级宏观经济学这门课。宏观经济学博大精深,内容错综复杂,除了涉及消费、储蓄、投资、政府开支、税收、货币、工资、就业与失业、物价水平与通货膨胀,以及国际贸易、政策管理等与“国民收入决定及其波动”紧密相关的问题外,还涉及关于这些问题的不同流派的观点和方法的介绍与比较,以及“开放经济的宏观经济学”等问题。因此,讲好中级宏观经济学这门课有相当的难度。而写好《中级宏观经济学》这本书也非常难。笔者发现,虽然有原版进口的教材,还有国内学者编写的教材,但都没有“合适”的。每到开课,都不知用什么教材。

适逢 2007 年华东师范大学研究生院开展研究生教材建设的契机,笔者申请了“中级宏观经济学”课程建设,有幸被选中,便尝试编写一本所谓的中级教程。然而三年过去了,教材迟迟无法编写完成。因为笔者发现,自己编写的内容同样摆脱不了数理的推导,所以很难说是“合适”的。加之目前的经济管理类研究生中有许多是跨专业考过来的,尽管他们很努力,但是他们在经济学方面的积累并不多,专业基础比较弱,要开设一门适合学生现状特点的中级宏观经济学教程,难度太大。如果还在初级经济学基础上原地踏步,不进行深入的专业训练,我们的研究生是很难看得懂国内外经济学论文的(尤其是一流杂志上的论文),这样的话,还怎么进一步作研究呢?笔者纠结了很长时间后,决定把上课讲义进行整理和拓展,尽量使用简单的数学方法将学生引上更高一级的经济学学习之路。经济学本身是对经济现象的描述(Description)、解释(Explanation)、预测(Prediction)和提出政策建议(Recommendation),简称为 D、E、P、R。这四个层次是逐渐提高的,经济学也要求学习者按照这四个层级进行学习和研究。对于初级经济学的学习,主要要求学习者做到 D 和 E;对于中高级经济学的学习,除了要求做到基本的 D、E 外,还要能做到 P、R。因此,本书在编写过程中除了理论的文字描述和图表的展示外,我们适度引入数理推导和计量方法的

介绍,尽可能地展示宏观经济问题的微观机制,以提高教学效果,激发学生的学习热情。

虽然本书关于宏观经济学问题的介绍、分析,尽可能做到具有系统性、逻辑性和递进性,但是由于其内容的庞杂,加之篇幅所限,以及上课学时要求的限制,我们没有专门辟出财政政策和货币政策两章,而是将其部分内容融进了第二章和第三章,也没有将非常有趣而重要的“制度与经济增长”问题编入教材。希望在以后的版本中能弥补这些缺陷和遗憾。

为了便于读者更好地理解 and 把握每章的内容,我们尽量将书中所使用的数学工具用附录形式收在书后。有些较复杂的数理推演,也放在附录里,以利于对正文的理解。同时,我们在每章的最后都附加了“本章小结”和“复习题”部分。其中一些思考题有一定的挑战性,需要读者对经济学有关内容融会贯通后才能较好解决。

本书是在上课讲义的基础上整理、拓展编写而成的,其中第六章第一节的“铸币税与通货膨胀”和第三节由曹海军博士完成,其余皆由笔者一人完成。本书绝大部分内容在华东师范大学商学院 2002 级到 2010 级的硕士研究生教学中使用过,并且得到了许多同学的批评指正,在此表示感谢。

感谢北京大学出版社的王业龙老师、华娜和朱梅全编辑,感谢他们对我迟迟不能交稿的宽容,和交稿后对文字、字符、图表的一丝不苟的校对,感谢他们与笔者一道对本书某些观点进行反复推敲和讨论。他们为本书花费了大量的时间和精力,没有他们的努力和鼓励,本书也很难付梓。

本书难免存在错误和不足,恳请读者批评指正。

方显仑

2011 年 6 月于丽娃河畔

目 录

第 1 章 绪论	(1)
第 1 节 经济学的演化规律:流派之争	(1)
第 2 节 中级宏观经济学课程内容、特点及研究方法	(6)
第 2 章 古典宏观经济学	(9)
第 1 节 古典理论中的总供给决定	(10)
第 2 节 古典模型中的商业周期	(18)
第 3 节 古典模型中的财政政策冲击	(23)
第 4 节 古典模型与货币政策	(26)
本章小结	(34)
主要概念与术语	(36)
复习题	(36)
第 3 章 凯恩斯主义	(42)
第 1 节 实际工资刚性	(43)
第 2 节 价格粘性	(48)
第 3 节 凯恩斯主义 AS 曲线	(52)
第 4 节 凯恩斯模型框架下的财政货币政策	(56)
第 5 节 新古典综合	(63)
第 6 节 凯恩斯商业周期理论与宏观经济稳定	(67)
第 7 节 非均衡宏观经济理论	(73)
第 8 节 M-F 模型与开放条件下的宏观经济政策	(75)
本章小结	(89)
主要概念与术语	(91)
复习题	(91)
第 4 章 消费理论	(97)
第 1 节 凯恩斯消费函数及其缺陷	(97)
第 2 节 跨时期消费决策	(98)
第 3 节 跨期最优决策条件下消费函数的决定	(100)

第4节	恒久性收入消费理论	(103)
第5节	不确定(附加预期)条件下的消费理论	(110)
第6节	影响消费的其他因素	(115)
第7节	中国消费案例研究	(120)
	本章小结	(125)
	主要概念与术语	(126)
	复习题	(126)
第5章	跨期理论中的投资决策	(128)
第1节	投资函数决定:一部门模型	(128)
第2节	最优投资决策理论的简单扩展:两部门与三部门模型	(131)
第3节	加速原理与投资决定	(133)
第4节	新古典投资理论	(135)
第5节	托宾 q 与最优投资决策	(142)
	本章小结	(144)
	主要概念与术语	(145)
	复习题	(145)
第6章	通货膨胀与失业	(146)
第1节	通货膨胀的成因	(146)
第2节	通货膨胀的效应	(159)
第3节	低通货膨胀货币政策的动态不一致性及其解决方法	(162)
第4节	失业理论——贝弗里奇曲线	(169)
第5节	通货膨胀与失业的关联	(176)
	本章小结	(186)
	主要概念与术语	(187)
	复习题	(187)
第7章	Solow-Swan 增长模型	(189)
第1节	新古典生产函数的性质	(189)
第2节	资本存量的基本动态方程	(191)
第3节	转移动态分析	(198)
第4节	技术进步与 Solow-Swan 模型	(203)
	本章小结	(207)
	主要概念与术语	(208)
	复习题	(208)

第 8 章 内生增长模型	(211)
第 1 节 AK 模型	(211)
第 2 节 具有转移动态的内生增长	(213)
第 3 节 不变替代弹性生产函数	(215)
第 4 节 增长模型中的贫困陷阱	(220)
第 5 节 知识积累模型	(222)
本章小结	(227)
主要概念与术语	(228)
复习题	(228)
第 9 章 Ramsey 模型	(230)
第 1 节 家庭与企业的最优决策	(230)
第 2 节 均衡与稳定状态的确定	(233)
第 3 节 稳态路径的动态分析	(236)
第 4 节 外生技术进步因素的 Ramsey 模型	(241)
本章小结	(242)
主要概念与术语	(244)
复习题	(244)
主要参考文献	(245)
附 录	(249)

绪 论

宏观经济学作为一门专业基础课课程,是学好整个经济学和管理学课程的前提。学习研究宏观经济学的目的是提高我们对经济现象进行正确深入分析的能力,掌握分析经济问题的基本方法。

本课程逻辑体系较为严密,前后连贯性强,具有理论性、逻辑性、实用性等特点。

第1节 经济学的演化规律:流派之争

经济的英文是“Economy”,它是从希腊文演变而来的,本意是家庭管理。经济学的古义就是经世济民之学。所谓经世就是管理世事,济民就是造福于民。因此,经济学是学以致用科学。

现代经济学包含微观经济学(Microeconomics)和宏观经济学(Macroeconomics)两大学科,前者研究个体行为,后者研究总体的经济关系,但两者不是简单的加总关系。

西方经济学总体的演化规律是:危机→革命→综合→新的危机→新的革命→新的综合,从这样的演化趋势和规律中,我们可以找到宏观经济学的位置,并发现宏观经济学与微观经济学是革命者与被革命者的关系。

我们一般把在理论观点、分析方法、政策主张上基本一致的经济学家们称作某一个经济学流派。

一、古典经济学的危机和边际革命

古典经济学的时间跨度是17世纪中叶到20世纪初。

1. 经济学史前——价值论的萌芽

以贵金属为形式的财富产生于流通领域,即商业领域,因此国家应大力发展商业。这一学派称为重商主义,其代表性观点是价值产生于流通领域。

2. 劳动价值论

经济学说史上的创世纪之作当属 1776 年英国经济学家亚当·斯密(Adam Smith)发表的《国民财富的性质和原因的研究》,简称《国富论》,它标志着经济学作为一门独立的学科诞生。《国富论》确立了被今天的宏观经济学家称为古典主义的哲学基础,其中,亚当·斯密提出了“看不见的手”的概念,即市场力量本身像一只看不见的手引导经济活动达到最优。市场的每一个个体都根据自身的利益最大化原则进行生产和交换,市场整体就能达到最优状态,因此无须政府的干预。

古典主义的基本原理主要包括以下内容:

(1) 萨伊法则(Say's Law)

法国经济学家萨伊(Jean-Baptiste Say, 1767—1832 年)在 1803 年出版的《政治经济学概论》中指出,一种产品一经创造出来,马上就会为其他产品提供一个与其自身价值完全相等的市场,从而为其他产品的销售打开出路。此即“供给自动创造需求”的萨伊法则。

(2) 充分弹性假说

工资具有充分弹性,这意味着劳动力市场是自动实现均衡的,不存在失业情况。价格具有充分弹性,意味着商品市场是能够自动实现均衡的,既不存在生产过剩,也不存在生产不足。由于储蓄是利息的增函数,而投资是利息的减函数,利息具有充分弹性意味着“储蓄必然全部转化为投资”。这是萨伊法则的另一种说法。

古典经济学认为价值主要来源于生产领域,因此古典经济学的最大成就之一就是劳动价值论的创立。劳动价值论从根本上否定了流通价值论。

3. 约翰·穆勒的综合

经济学说史上第一次综合是英国经济学家约翰·穆勒(John Stuart Mill)的创举。这体现在 1848 年约翰·穆勒出版的第一部具有历史意义的著作《政治经济学原理》中。他认为劳动的报酬是工资,资本的报酬是利润,土地的报酬是地租。约翰·穆勒实际上从生产的不同方面说明了生产要素与价值的决定与价格的形成。这就是经济学史上第一次综合,也是约翰·穆勒一个最大的成果。

4. 古典经济学的危机与边际革命

古典经济学的危机源于所谓的新旧葡萄酒之争,也就是价格问题。新旧葡

葡萄酒价格差别导致了英国古典经济学从几乎独一无二的权威与统治地位上迅速衰败下来。

边际革命产生于19世纪70年代,并出现“边际三杰”:奥地利的门格尔(Carl Menger, 1840—1921年)、英国的杰文斯(William Stanley Jevons, 1835—1882年)和法国的瓦尔拉斯(Leon Walras, 1834—1910年)。三人几乎同时提出了边际效用价值论。边际效用价值论反对劳动价值论,认为商品的价值不是取决于商品中所包含客观的劳动,而是取决于商品消耗的主观评价。这是与古典经济学对立的主观价值论。门格尔认为劳动价值论是一个极大的谬误,而且是第一个谬误。商品的价格应该等于商品的边际效用除以货币的边际效用,用公式表达为 $P=MU/\lambda$ 。

二、马歇尔的综合和新古典经济学的形成

马歇尔(Marshall)将劳动价值论和效用价值论有效结合,这是经济学说史上第二次综合(称为剑桥学派)。这体现在马歇尔1890年出版的《经济学原理》一书中。马歇尔提出了具有创造意义的均衡价值论,把均衡从物理学中引入经济学中。

马歇尔认为,各种对立的变动的力量处于一种力量相当、相对静止、不再变动的境界就是经济学的一种均衡境界。在经济学中,需求与供给是完全对立的,消费与生产也是完全对立的,买者与卖者也是完全对立的。边际效用价值论可以解释需求、消费、买者的行为;而劳动价值论可解释供给、生产、卖者的行为。由此,古典经济学被继承发扬为新古典经济学。

三、新古典经济学的危机和凯恩斯革命

1. 新古典经济学的基本前提假设,或者说微观经济学的基本前提假设

(1) 理性人假设

这是新古典经济学的假设,或者说是经济人假设。古典经济学家认为人的本性是追求私利。经济人的含义是人们不论是否出于利己的动机,都力图以最小的经济代价去追逐和获得最大的经济利益。最大化原则和经济人假设、理性人假设是完全等同的。

既然理性经济人就是追求净收益极大化者,那么消费者或者居民追求的就是商品消费中的主观效用极大化,并以此来评价商品(也包括劳务)的价值。因此,主观效用价值论就是主观心理的评价决定商品的价格。这在世界观上很显然是对古典经济学的劳动价值论的一个否定。

(2) 信息完全假设

在经济生活中经济人目标的实现,不仅需要主观动机,也需要一些客观条

件。对消费者来说,价格反映了商品的边际效用: $P=MU/\lambda$;对生产者来说,价格等于短期边际成本: $P=SMC$ 。只有当信息是完全的,市场价格机制才会是有效的,资源才能实现优化配置。

在市场中怎样才能使信息是完全的?它需要完全竞争假设来保证。只有完全竞争,才能保证价格传递的信息完全、充分、如实反映供求的实际状况。

(3) 市场出清假设

它是建立在最大化原则及信息完全假设之上的。需求大于供给,导致价格上升,消费者会减少需求量,而供给者会增加供给量,从而供求重新达到相等,这就是市场出清。市场出清包含两层含义:一是每个市场参与者,无论是消费者、生产者还是卖者,都实现了各自的利益最大化;二是经济当事人之间的行为是相互协调、相互兼容的,他们共同行为的结果导致比率或者价格的变化,也就是市场出清的一种状态。

马歇尔论证了局部均衡的存在,也就是一个市场出清的存在。产品市场会达到供求相等,不会存在生产过剩;而劳动力市场会达到充分就业,不会存在失业。新古典的均衡论认为,虽然市场经济偶尔会偏离均衡位置,但是有市场内力(“看不见的手”)或者价格机制作用,可使它恢复均衡状态(常态)。

因此,新古典经济学的政策主张是政府应充当“守夜人”或者“看门犬”的角色。

2. 凯恩斯革命

1930年资本主义世界出现了大萧条,持续时间长达十年之久。40%的国民收入降幅和25%的失业率足以说明危机的破坏性。

凯恩斯在1936年发表《就业、利息和货币通论》(简称《通论》),他认为市场经济偏离均衡是常态;必须用“看得见的手”即国家干预,推动市场机制,使它恢复偶然的均衡。

凯恩斯学派的基本观点包括以下三点:

(1) 刚性工资(Rigid Wage)假说:工会的集体谈判,使工资向下是刚性的;劳动者关心的是工资的横向比较,由此产生了所谓“货币幻觉”。

(2) 储蓄不等于投资的分析:不同的人根据不同的因素会作出不同决策,因而储蓄和投资一般不会相等。

(3) 有效需求(Effective Demand)的分析:边际消费倾向递减表明有效需求的不足;资本边际效率递减表明有效投资的不足;若人们对货币具有流动性偏好,即手持货币而不购买债券,这会导致有效需求不足。

总之,微观的有效不一定能实现宏观的有效,所以要进行宏观经济学的研究。

四、萨缪尔森“新古典综合”(Neo-classical Synthesis):后凯恩斯主流经济学

萨缪尔森在1984年出版了《经济学》，将凯恩斯理论与新古典方法有机结合，也是经济学说史上第三个具有里程碑意义的经济学的综合，被称为新古典综合，这也标志着凯恩斯主义的形成。

萨缪尔森的综合实际上是两种意义的综合：

(1) 理论的综合

萨缪尔森将凯恩斯有效需求不足理论与传统经济学(古典经济学)有效率的配置理论和方法统一起来。他认为如果现代经济学能够很好地完成任务，使得自由社会大体上能够消除失业和通货膨胀，那么它的重要性就会减退；而传统经济学(古典经济学)关心有效率的资源配置，也就是实现充分就业的资源配置和利用。

萨缪尔森集凯恩斯和新古典经济学之大成：引进新古典微观经济学补充凯恩斯宏观经济理论；引进市场调节机制以补充国家干预的经济政策；认为混合经济完全可实现充分就业的均衡。

(2) 形式上的综合

随着凯恩斯理论被命名为宏观经济学，新古典经济学以微观经济学的新名称出现，两种理论顺次结合在一起称为综合。萨缪尔森的贡献在于使凯恩斯理论被广泛传播，从而最终确立了凯恩斯理论在西方经济学的主流地位，并且使它演变为当代宏观经济学。

根据萨缪尔森的理论，我们所讲的长期存在于资本主义制度的经济波动的现象仍然存在，但世界各国政府通过干预使其不至于发展成为一个巨大的危机。

宏观经济学与微观经济学是革命与被革命的关系，似乎是完全对立的经济理论。微观经济学强调的是市场机制范畴理论；宏观经济学从本质上说明市场机制有内在的不稳定性和非均衡趋势，所以需要国家干预。

五、新剑桥学派：凯恩斯主义的一个分支

在萨缪尔森的理论在世界各地传播的同时，英国新剑桥学派的代表人物、经济学家琼·罗宾逊夫人(Joan Robinson)和卡尔多(Nicholas Kaldor)，成为萨缪尔森的论敌，双方的论战持续了十多年。他们认为新古典综合派是冒牌的凯恩斯主义，在方法论上应抛弃均衡概念，树立历史的时间观念，并强调社会制度和阶级分析方法。

他们认为新古典综合在综合过程中，承袭了马歇尔的局部均衡理论和瓦尔

拉斯的一般均衡理论,把这些已经被凯恩斯革命破除了的“均衡”概念重新恢复移植到凯恩斯理论中,是理论上的倒退,是对凯恩斯理论的庸俗化。按照琼·罗宾逊夫人的说法,均衡意味着将来与过去无区别,这是不可思议的,没有历史就没有凯恩斯。

另外,他们认为新古典的边际生产力分配理论是完全错误的;其一,没有考虑社会制度因素,把现行制度中工资、利润分配格局看成是公平合理的;其二,边际生产力分配理论在论证逻辑上是循环论证。

此外,宏观经济学在凯恩斯理论基础上进一步发展,形成新凯恩斯主义非均衡学派。比如1966年美国经济学家克洛沃和1968年瑞典的莱荣霍夫德就对以一般均衡理论来解释凯恩斯经济学提出了尖锐批评,认为凯恩斯学派曲解了凯恩斯经济学。之后美国的巴罗、格罗斯曼,法国的贝纳西、马兰沃德建立了“非均衡理论模型”,这一方面为凯恩斯宏观经济学奠定了微观基础,另一方面也促进了宏观经济理论本身的发展。

当然在经济学说史上还有与凯恩斯主义相抗衡的新自由主义流派,包括以米尔顿·弗里德曼为代表的货币学派、1970年代后期从货币学派中分离出来的以1995年获诺贝尔奖的卢卡斯为代表的理性预期学派、1980年代受里根政府推崇的供给学派(代表人物为美国的拉弗、费尔德斯坦),以及1960年代以来别具一格的新自由主义:公共选择学派(代表人物为布坎南、塔洛克)。

第2节 中级宏观经济学课程内容、特点及研究方法

一、基本内容

除绪论外,本课程主体内容主要分九章讲述:

第二章阐述古典(市场出清的)宏观经济学,主要论述包括古典理论中的总供给决定;古典模型中的商业周期;古典模型中的财政政策冲击与货币政策;古典模型中的失业等。

第三章分析凯恩斯主义。该章包括实际工资刚性;价格粘性原因;垄断竞争与菜单成本;凯恩斯主义AS曲线;凯恩斯模型框架下的财政货币政策;新古典综合及其宏观政策;凯恩斯商业周期理论与宏观经济稳定;非均衡宏观经济理论等。

第四章介绍消费理论。该章包括凯恩斯消费函数及其缺陷;跨时期消费决策;跨期最优决策条件下消费函数的决定;恒久性收入消费理论两时期模型与无限期界模型及其应用;不确定(附加预期)条件下的消费理论,如随机游走论、 λ 假说等;影响消费的其他因素,如税收、储蓄、利率等。

第五章探讨跨期理论中的投资决策。该章包括：投资函数决定：一部门模型；最优投资决策理论扩展：两部门与三部门模型；加速原理与投资决定；新古典投资理论：不考虑调整成本与调整成本模型；托宾 q 与最优投资决策。

第六章分析通货膨胀与失业理论。该章介绍了工资—价格动态表现的菲利普斯曲线方程；适应性预期的形成机制与菲利普斯曲线；理性预期与菲利普斯曲线；失业理论——贝弗里奇曲线推导，主要论述结构性失业、摩擦性失业、效率工资论、内部人—外部人理论等。

第七章介绍 Solow-Swan 增长模型。该章分析了新古典生产函数的性质，资本存量的基本动态方程、黄金律和动态无效，对人均资本和人均产出的转移作了动态分析，并阐述了技术进步是劳动增进型以及附加劳动增进型技术进步的 Solow-Swan 模型等。

第八章介绍内生增长模型。该章包括：AK 模型；具有转移动态的内生增长；不变替代弹性生产函数；增长模型中的贫困陷阱；知识积累模型等。

第九章介绍 Ramsey 模型。该章包括：家庭与企业的最优决策条件；均衡与稳定状态的确定；稳态路径的动态分析和储蓄率的动态变化；外生技术进步因素的 Ramsey-Cass-Koopmans 模型。

第十章分析制度与经济增长问题。

二、课程特点

从内容上，中级宏观经济学具有理论性、抽象性、广泛性的特点。我们是在初级宏观经济学的基础上进一步分析宏观经济理论，因此其理论性和抽象性可能比初级宏观经济学要复杂得多，而且其涉及面非常广泛，如消费、投资、通货膨胀、失业、经济增长、制度、政策等，几乎可以涉足我们工作、生活、经济、社会、文化、法律、政治中的每一个方面，在一定程度上，我们这门课所涉及的只是中高级宏观经济学“沧海”中之“一粟”。跨专业学习经济学专业的研究生同学需要补充学习初级经济学理论。

从形式上，它又有“理”、“图”、“数”的特点。所谓“理”，就是宏观经济学博大精深之理；“图”为诠释抽象而博大精深之理的几何图形，虽不够准确，或者只是定性分析与描述经济理论，但较为形象，易于理解；“数”则是经济学家为弥补“图”之不足而设计的定量描述经济理论的数学工具。研究生学习需要有一定的数学功底。本书在附录部分对书中所用到的数学工具作了简明扼要的介绍。

三、研究方法

本书立足于新古典研究范式,分析宏观经济学和宏观经济问题的微观基础,也就是利用优化方法,在问题的分析研究中强调使个体和市场达到最优。因此我们把它称作“大题小作”的研究思路。另外,研究生学习也要“小题大做”,即就某一宏观经济问题的某一方面的“小”问题,做出“大”文章来,把某一宏观问题的微观机制分析透彻、全面。

古典宏观经济学

古典宏观经济学又称市场出清的宏观经济学。这里首先概括一下古典经济学的基本前提：

- (1) 厂商和居民都是理性经济人；
- (2) 市场属于完全竞争型的市场；
- (3) 经济主要划分成两个部门：真实部门与货币部门（或称名义部门），且两部门是分离的，这就是所谓的古典二分法(Classical Dichotomy)；
- (4) 名义工资具有充分的弹性，劳动市场的均衡可由工资率变化来调整；
- (5) 货币数量的变化不影响真实变量的均衡值。

我们利用古典的或市场出清的 IS-LM 和 AD-AS 模型，因为假设价格和工资迅速调整，故经济始终处于或接近一般均衡。因此，产出与就业等变量始终接近一般均衡水平。

古典理论与许多重要的商业周期的事实相一致，但货币存量的变化引起的商业周期与古典理论预测的结果不一致。古典理论假设工资价格迅速调整到市场出清水平，所以经济会迅速达到长期均衡。货币中性意味着货币供给的变化不会影响产出和其他实际变量。然而，大多数经济学家解释说货币能导致经济周期性变化，因此货币是非中性的。如果的确存在货币非中性(Monetary Nonneutrality)现象，古典模型必须进行修正或者放弃。本章将扩展古典模型允许货币非中性，并把这个扩展的古典方法应用到宏观经济政策。