

 21 世纪高等院校教材

Macroeconomics

宏观经济学

王辛枫 曲世友 ● 主 编

 科学出版社
www.sciencep.com

21 世纪高等院校教材

宏 观 经 济 学

王辛枫 曲世友 主编

科 学 出 版 社

北 京

内 容 简 介

本书系统地反映了当代宏观经济学的最新进展。全书依次介绍了宏观经济学的基本知识、总需求分析、总供给分析、宏观经济学的主要问题以及开放经济中的宏观经济学等内容。本书结构新颖合理,内容丰富,论述问题全面,具有一定的学术价值。

本书可供高等院校经济管理类本科生、专科生和在职研究生参考使用。

图书在版编目(CIP)数据

宏观经济学/王辛枫,曲世友主编. —北京:科学出版社,2004.8

(21世纪高等院校教材)

ISBN 7-03-013751-5

I. 宏… II. ①王…②曲… III. 宏观经济学-高等学校-教材
IV. F015

中国版本图书馆 CIP 数据核字(2004)第 061541 号

责任编辑:卢秀娟/责任校对:朱光光

责任印制:安春生/封面设计:陈 敬

科 学 出 版 社 出 版

北京东黄城根北街16号

邮政编码:100717

<http://www.sciencep.com>

源海印刷有限责任公司印刷

科学出版社发行 各地新华书店经销

*

2004年8月第 一 版 开本: B5(720×1000)

2004年8月第一次印刷 印张: 13 3/4

印数: 1—3 000 字数: 261 000

定价: 22.00 元

(如有印装质量问题,我社负责调换〈路通〉)

前 言

随着中国向社会主义市场经济转轨,在理论上深入理解市场机制已成为一种迫切需要。当前我国经济发展中许多人民所关心的“热点”问题,例如经济发展的速度问题,投资规模问题,通货膨胀问题,就业问题,货币投放与资金紧缺问题,无不是与宏观经济学相关的。

本书是专门为高等院校经济管理类本科生、专科生和在职研究生的教学而编写的;同时,也兼顾到有一定理论素养的实际操作者和非经济理论专业研究生的需要,并希望这本篇幅有限的教科书对于愿意跟上国外经济理论发展的青年教师与研究人员也能有所帮助。

本书的特点可以概括为以下几个方面:

1. 篇幅不大但内容充实、体系完整。在表达上尽可能精练、准确,删除相互并列或相互抵触的模型,保持逻辑上的前后一致。

2. 本书突出了经济分析方面的内容,让概念与变量在相互关系中自然地展开。为此,本书除了图形以外也使用了一些数学表达式,但是其难度绝不超过初等代数变换和最基本的微分常识。

3. 考虑到中国市场经济尚不发达的国情,为使表述不致过于抽象,本书在适当的地方增加了关于市场动态调整过程的论述,并对政策在经济活动中如何发挥作用作了更为具体的说明。

本书由王辛枫、曲世友、王海、王树林、周燕等多名教师编写。经济学知识在中国的普及与发展需要几代人的努力,我们希望为此做出自己的一份贡献,当然,限于作者的水平,书中难免有不妥之处,恳切希望读者指正。

目 录

前言

第一章 宏观经济学导论	1
第一节 宏观经济学的研究对象	1
第二节 宏观经济学的研究方法	4
第三节 宏观经济学的产生和发展	8
第二章 国民收入核算	16
第一节 产品流量和收入流量的循环流转	16
第二节 国民收入核算中的总量及其关系	17
第三节 总需求的构成	20
第四节 国民收入核算中的恒等关系	22
* 第五节 存量核算:国民净资产与国际净投资地位	24
第三章 简单的国民收入决定模型	27
第一节 均衡产量水平	27
第二节 收入与支出:消费、储蓄与投资	29
第三节 乘数理论	34
第四节 三部门经济中国民收入的决定	37
第四章 产品市场与货币市场的均衡:IS-LM 模型	44
第一节 IS 曲线与产品市场的均衡	44
第二节 LM 曲线与货币市场的均衡	49
第三节 IS-LM 模型:产品市场与货币市场的均衡	55
第四节 货币政策的效应与机制	59
第五章 宏观经济政策	62
第一节 有效需求理论	62
第二节 财政政策的挤出效应	65
第三节 宏观经济政策的选择与配合	67
第四节 实行宏观经济政策所面对的困难	71
第五节 进取性政策与非进取性政策	75
第六章 消费函数理论	77
第一节 消费函数之谜	77
第二节 相对收入假说	81
第三节 财产-终生收入假说	83
第四节 持久收入假说	92

第七章 投资函数理论	97
第一节 由投资的成本-收益分析导出的投资函数	97
第二节 从总量生产函数导出的投资函数	105
第三节 由产出引致的投资	109
第四节 资金供给对投资的影响	113
第五节 对投资理论的总结	115
*第八章 货币需求与货币供给理论	118
第一节 货币的定义与职能	118
第二节 货币需求理论	118
第三节 货币流通速度与货币数量说	124
第四节 货币供给理论	126
第五节 货币政策目标的选择	133
第九章 总需求与总供给	139
第一节 总需求与总供给分析	139
第二节 总需求曲线的推导	141
第三节 AS 曲线的形状与政策效果	145
第四节 理性预期学派的总供给模型	148
第十章 失业与通货膨胀理论	153
第一节 失业理论	153
第二节 通货膨胀理论	159
第三节 失业与通货膨胀的替代关系	167
第十一章 经济周期理论	172
第一节 经济周期的基本知识	172
第二节 乘数-加速数经济周期模型	176
第三节 实际经济周期模型	181
第十二章 经济增长理论	184
第一节 经济增长理论概述	184
第二节 哈罗德-多马经济增长模型	186
第三节 新古典经济增长模型	189
第四节 新经济增长理论	196
第五节 经济增长因素分析	199
第十三章 开放经济理论	204
第一节 开放经济中 IS-LM 模型与国民收入均衡	204
第二节 国际收支平衡	207
第三节 实现国际收支平衡的机制	208
第四节 内外宏观经济目标的协调	210

第一章 宏观经济学导论

第一节 宏观经济学的研究对象

一、宏观经济学的定义和研究对象

宏观经济学(macroeconomics)也叫做总量经济学,它把社会经济体系看作一个整体,分析不同经济活动总量之间的相互关系及其对总体经济表现的影响,以求理解总体经济的运行机制。它研究的是整个国民经济的经济行为,涉及的内容是整个社会的价格水平、总产量、就业水平和其他经济总量的决定。宏观经济学对这些问题的研究是围绕着宏观经济的短期波动和长期增长展开的,目的就是要通过对于这些问题的研究,弄清一国现有资源未能得到充分利用的原因,达到提高经济资源运用整体效率的目的。

“宏观经济学”是理论经济学的一个重要方面。它和“微观经济学”共同构成理论经济学的基础。微观经济学注重经济活动中各经济主体如何作出各自的最优选择以及如何协调他们的选择(通过市场或通过等级制度),强调的是个别经济主体(家庭、厂商和政府机构)的活动是如何联系起来而成为一个整体的。宏观经济学则把所有经济主体的同类活动归类为一个总量范畴(如把所有家庭的消费加总为总消费),把另一些活动归类为另一个总量范畴,研究所有经济主体的这一类活动总量与另一类活动总量之间的关系,以及它们对整体经济表现的影响。所以微观经济学与宏观经济学的区别主要不在于研究对象的范畴大小与层次高低,而在于对整体经济活动内部联系的不同划分与把握。

二、宏观经济学研究的基本问题

宏观经济学的主要内容是研究国民经济的总量经济、结构、机制和绩效以及政府怎样运用经济政策来提高经济的绩效。这些内容一般涉及以下一些基本问题。

1. 总产出

既然宏观经济学是以整个国民经济活动作为研究对象的,它必然要分析与整个国民经济活动有关的或与一国的总产出或经济资源利用情况有关的最基本的总量:国民生产总值、国民生产净值、国民收入以及相应的经济总量的决定与变动。因此对总产出或国民收入水平的研究是宏观经济学的核心问题。宏观经济学就是要从总需求和总供给的角度出发,分析国民收入决定及其变动的规律。在此基础上进一步研究和解释整体经济中的其他各种问题。

2. 充分就业

产量与就业水平的决定是各国普遍关心的问题。为什么总体经济活动水平时高时低?为什么繁荣与衰退交替出现?资源是充分利用了还是存在闲置现象?西方经济学家一直在花费大量精力对各种不同类型失业的原因、机制、影响及解决它的政策和对策进行研究,提出了各种各样的理论观点和政策主张。因此,充分就业问题成为宏观经济学研究的基本问题之一。

3. 通货膨胀

物价水平为什么总是在变动?为什么通货膨胀或通货紧缩始终伴随着经济增长?为什么会出现滞胀?通货膨胀时期人们的货币收入也在增长,但人们仍不喜欢通胀,它到底造成了什么危害?通货膨胀对购买力产生了什么影响?通货膨胀的出现与经济中货币的发行量有着什么样的联系?货币是人类的发明,不是自然的产物,因此它的多少是可以由人类自己来控制的。经济学家关心的是货币数量变化的原因和结果,以及这种变化对价格水平的影响,同时还要研究引起通货膨胀的其他原因。

4. 经济周期与经济增长

经济周期是指经济活动沿增长趋势线多少有些规则地交替出现扩张与收缩,指国民收入的短期波动。经济增长指国民收入的长期增长趋势。为什么各个国家都要面临国民收入短期波动?经济的生产能力是否增长?为什么不同的国家的经济增长速度是不同的?导致经济波动与增长的原因是什么?一般来说,生活水平较高的一些国家的经济增长速度要快一些,其结果是穷国和富国之间的生活水平就越拉越大了,怎样解决这个问题,长期增长的源泉是什么?怎样才能实现经济的稳定增长?经济增长的代价又是什么?这是宏观经济学研究的又一个问题。

5. 开放经济理论

现实的经济是开放型经济,对外经济交往对本国经济具有很大的影响。在世界经济一体化的趋势中,世界的变化不仅会影响一国的贸易收支、资本流动和汇率波动,而且会直接影响国内的产量、物价、利率及宏观经济政策的效果。开放经济理论要分析一国国民收入决定与变动如何影响别国,以及如何受到别国的影响,同时也要分析开放经济条件下一国经济的调节问题。

6. 宏观经济政策及其效果

宏观经济学是为国家干预经济服务的。宏观经济理论要为这种干预提供理论依据。而宏观经济政策则是要为这种干预提供具体的措施。宏观经济政策是从全局上对经济运行施加影响的方法和手段。它的目的是减轻经济的波动(失业率、通胀率与增长率的波动),将波动限制在一个窄幅范围内,所以这些政策又被称为稳定化政策。稳定化政策主要由两大政策组成:一是由中央银行控制的货币政策,包括改变货币供给量,改变商业银行向中央银行借钱时的贴现率及对所有金融机构

规则的监管;二是由政府行政当局提出由国会批准的财政政策,包括税收政策和政府支出政策。尽管稳定性政策的作用机制在理论上可以分析清楚,但在现实中,它并未能将失业、通胀与增长率的波动成功地限制在窄幅范围内。其原因就在于货币政策与财政政策影响总需求与总供给的时效(政策效用的时间分析)与范围都具有不确定性,难以准确预见。此外政府决策程序的规则与特殊利益集团的干扰也限制了政策的作用。成功的政策可以减轻经济波动,而不成功的政策反而会加剧经济的波动。这种情况引起了关于政府政策干预必要性的争论。

三、流派之争

近三十年来在宏观经济学领域中影响最大的主要是三派:新凯恩斯主义,新古典主义与货币主义。(此外还有一些较小的学派如供给学派、新剑桥学派、激进主义学派等)。下面我们来概括一下这三派在政策主张上的分歧。

新凯恩斯主义在政策主张上与老凯恩斯派相似,相信政府通过稳定化政策进行积极干预,可以改善总体经济表现。尽管实施政策会遇到许多困难与失误,但随着知识与技巧的增进,政策失效并非不可避免。反倒是市场不可能仅仅由于人们追逐自己私利的理性选择就连续出清,因为个别主体获取加工信息的能力有限,调整工资与价格又并非毫无代价,因此工资与物价的滞后调整(工资-价格黏性)是必然的,结果导致产量与就业水平的波动。这种市场失效只能由政策予以补救,且不乏成功的先例。

新古典主义则认为,每个追求自身利益最大化的经济主体都会运用当时可获得的信息作出最优决策,因此不管政府采用什么政策,人们最终都将理解政府的意图,并且根据改变了的情况按照自己的利益去做,而不会按照政府的意图去做。政策能否成功取决于私人主体怎么理解政府的政策目标,怎么做出回应,而这一点是难以预见的。相反,倒是在市场上,如果调整工资与价格对工人与厂商有利,他们没有理由不这么做,这就导致市场连续的均衡,不可能存在非自愿失业。卢卡斯有一句名言:“地上不会有一张 50 美元的钞票”。意思是说,如果有任何方式可以改善人们的处境,他们早就这么做了。无须政府来教他们做或替他们做。

货币主义也坚持认为经济波动是政府政策行动的结果,而不是私人部门内在不稳定性的结果。货币主义是最先向凯恩斯主义的正统地位提出挑战的学派,它与凯恩斯主义的许多争论已收在后文的阐述中,例如,货币政策有效还是财政政策有效;货币数量与通胀之间的关系;失业与通胀之间是否存在替代关系;是否应该设立固定的货币增长规则等。货币主义主张小政府,反对财政赤字和大量发行公债,而主张政府在衰退时减税,在繁荣时削减政府开支,使政府活动在经济中所占比重逐步下降。他们还赞同建立固定的政策规则,限制政府相机抉择的能力,以避免政府滥用权力、扰乱市场的正常运行。

总之,政府能否及应否有些事来改进总体经济表现,一直是宏观经济学中的一个重大问题。一代又一代的经济学家为此而争论,这些争论澄清了一些问题,推动宏观经济分析向更深入的方向发展。

第二节 宏观经济学的研究方法

宏观经济学是一门内容极其复杂的学科。这一方面是由于该学科至今仍然处于不断发展变化之中,其理论内容充满了存有争议的问题和观点;另一方面是由于新的分析方法和新的研究角度被不断地被引入该学科,形成了不同的流派和表达方式。所以,在学习宏观经济学的时候,注意研究方法是十分必要的。

一、总量分析方法

我们已经知道宏观经济学是以国民经济的整体情况和问题作为研究对象的,这就决定了它的研究方法也与微观经济学有很大的不同,它特别强调总量分析方法。总量分析方法就是指我们在分析有关问题时,要把一些具体的、分散的经济变量合理地综合与抽象成一些反映总体经济情况和问题的、更加概括的经济变量。总量是指能反映整个经济运行情况的经济变量。这种总量有两类:一类是个量的总和,如国民收入、总投资、总消费等。另一类是平均量,如价格水平、就业水平等。宏观经济学涉及的总量很多,主要有:国民生产总值、总投资、总消费、价格水平、就业水平、货币供给量、货币需求量、利率、进出口额等。用总量分析方法分析问题,着重于大的经济趋势和动向,整体的经济反映和效果,而不必过分关注具体的、个别的解决问题或经济变量。

研究总体经济表现的最基本方法是总供给与总需求分析。从图形上看(图1-1),总供给(AS)曲线向右上方倾斜,总需求(AD)曲线向右下方倾斜。它们的交点E同时决定了一个均衡产量水平(Y^*)和一个均衡物价水平(P^*),似乎与微观经济学对某个产品市场的供求分析没有什么差别。但是这两条曲线背后却有着与微观经济学完全不同的经济含义。为什么AS曲线向上斜而AD曲线向下斜?它们的斜率由哪些因素决定?它们的移动受哪些变量影响?这些我们将在后面的章节中逐步展开。这里要指出的只是,总供给与总需求是宏观经济分析的主线。

第二个要提出的问题是,哪些因素(变量)影响总供给与总需求?回答是:宏观经济学研究的所有因素。这些因素主要分布于四类市场即产品市场、货币市场、劳动市场与世界市场。如果进一步细分的话,则产品市场又可以分为投资品市场与消费品市场;货币市场则与其他资产(股票、债券)市场紧密相连;劳动市场又与资本市场和自然资源市场相互依存;而世界市场又可分为进出口产品市场与国际金融市场。读者自然会想到,每个市场有每个市场的均衡。事实上每个市场的均衡

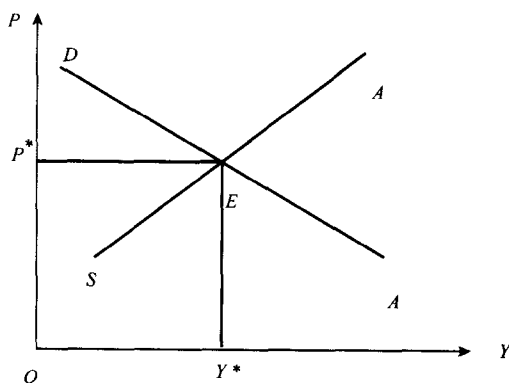


图 1-1 总供给曲线与总需求曲线

Y:产量——收入水平;P:物价水平;AS:总供给;AD:总需求

都依赖于其他市场的均衡,一个市场上一种因素的变动不仅会引起这个市场的调整,而且会引起其他市场的调整,从而引起总供给或总需求的调整,使总体经济活动趋向于新的均衡水平。

后面我们对总需求的分析,是从产品市场开始的,接着再把货币市场包括进来,最后再考虑世界市场,即外部的产品市场和外部的金融资产市场。而对总供给的分析则从对劳动市场的分析入手。在引入总供给分析之前,我们一直假定均衡产量的变动全是由总需求的变动引起的,也就是说产量的变动不会遇到来自总供给方面的阻力,也不会引起物价水平的变动。直到总供给分析进入我们的视野,对物价水平变动的分析才得以展开。

除了市场因素外,影响总需求与总供给从而影响总体经济表现的还有政府实行的宏观经济政策。每一项政策措施的效果也是综合性的,同时作用于各类市场,引起各市场的调整。我们对各市场的分析一开始就引入政策的影响,并且将后面的分析叠加到前面的分析之上,最后得出一幅总的图案。

以上只是对宏观经济分析方法的一个极为简略的勾画,目的是提醒读者:宏观经济分析的主要困难就在于理解几个市场之间及众多变量之间的相互作用。

二、实证分析方法与规范分析方法

实证(positive)分析方法是描述经济中的事实、情况和关系。实证分析企图超越和排斥一切价值判断,只考虑建立经济事物之间关系的规律,并在这些规律的作用下,分析和预测人们经济行为的效果。它具有两个特点:第一,它要回答的是“是什么”的问题;第二,它所研究的内容要具有客观性,它的结论是否正确可以通过经验事实来进行检验。

规范(normative)分析方法涉及伦理和价值判断。规范分析是经一定的价值判断和道德判断提出某些标准作为分析处理经济问题的标准,作为制定经济政策的依据,并研究如何才能符合这些标准。它也具有两个特点:第一,它要回答的是“应该是什么”的问题;第二,它所研究的内容没有客观性所得的结论,无法通过经验事实进行检验。

实证分析方法和规范分析方法在经济分析中都是必要的,但在西方经济学中,主要内容大部分是实证经济学。就宏观经济学的内容而言,实证分析也是基本的分析方法。它假设社会制度不变,撇开价值判断问题,深入地研究经济运行的内在规律。值得注意的是,规范分析方法在宏观经济学的研究中也是十分重要的,因为实证分析也无法完全回避价值判断问题。

三、均衡分析方法与非均衡分析方法

均衡分析方法是分析各种经济变量之间的关系,说明均衡的实现及其变动。均衡分析又可以分为局部均衡分析与一般均衡分析。均衡分析偏重于数量分析。

非均衡分析方法则认为经济现象及其变化的原因是多方面的、复杂的,不能单纯用有关变量之间的均衡与不均衡来加以解释,而主张以历史的、制度的、社会的因素作为分析的基本方法,即使是量的分析,非均衡也不是强调各种力量相等时的均衡状态,而是强调各种力量不相等时的非均衡状态。

宏观经济学和微观经济学一样,也大量运用了均衡分析方法,但是,它也用了微观经济学中所不常见的非均衡分析方法。一方面宏观经济学中的均衡分析方法并不是微观经济学中的局部均衡分析方法,而是更多地运用类似微观经济学中的一般均衡分析方法。另一方面,宏观经济学也大量运用了非均衡分析方法。因为从哲学的观点出发,世界上的任何事物均衡都是相对的,非均衡是绝对的,经济运行更是如此。现实生活中更多存在的是非均衡状态,即经济总是偏离均衡状态。因为经济均衡状态所要求的前提条件是非常严格的,同时达到这些条件是非常困难的,对于宏观经济来说甚至是不可能的。所以,非均衡分析在宏观经济学中日益受到重视。当然,均衡分析和非均衡分析两者间也存在着相互对应的关系,而不可以将两种方法截然对立起来。

四、静态均衡分析方法、比较静态均衡分析方法和动态均衡分析方法

静态分析与动态分析的基本区别在于,前者不考虑时间因素,而后者考虑时间因素。换句话说,静态分析考察一定时期各种变量之间的相互关系,而动态分析考察各种变量之间在不同时期的变动情况。静态分析主要是一种横断面分析,不涉及时间因素所引起的变动;而动态分析主要是一种时间序列分析,要涉及时间因素所引起的变动。或者说,静态分析研究经济现象的相对静止状态,而动态分析研

究经济现象的发展变化过程。

把均衡分析与静态分析和动态分析结合在一起就产生了三种分析工具:静态均衡分析、比较静态均衡分析与动态均衡分析。静态均衡分析要说明各种经济变量达到均衡的条件;比较静态均衡分析要说明从一种均衡状态变动到另一种均衡状态的过程,即原有的条件变动时均衡状态发生了什么相应的变化,并把新旧状态进行比较;动态均衡分析则要在引进时间因素的基础上说明均衡的实际变化过程,说明某一时点上经济变量的变动如何影响下一时点上该变量的变动,以及这种变动对整个均衡状态变动的影响。

静态分析与动态分析具有一定的联系。这种联系表现在:静态分析是动态分析的基础,它为动态分析提供基础数据,便于准确分析经济运行规律;而动态分析则是静态分析的发展和延伸。一般来说,先进行静态分析,在静态分析的基础上进行动态分析。在宏观经济学的分析和研究中,上述这三种方法都会遇到。

五、存量分析方法与流量分析方法

宏观经济学在以整个国民经济的活动作为研究对象时,可以采用存量分析方法,也可以采用流量分析方法。存量(stock)分析是指对一定时点上已存在的有关经济总量的数值及其对其他有关经济总量的影响进行分析。流量(flow)分析是指对一定时期内有关的经济总量的产出、投入(或收入、支出)的变动及其对于其他有关经济总量的影响进行分析。凯恩斯在《就业利息和货币通论》中进行总量分析时,虽然也对存货数量、银行存款总额等存量的变动做了分析,但他主要是分析收入的流量。一定时期内的总收入、总投资、总消费、总储蓄的变动及其造成的影响,是凯恩斯宏观经济学考察的重点。与存量分析相比,流量分析不仅在研究社会就业问题时有其更迫切的意义,而且在统计学上显得困难较小。但就宏观经济学所要研究的整个国民经济活动而言,流量分析无疑是不够的。这就是凯恩斯以后的一些西方经济学家在进行总量分析时,不断加强存量分析的原因。例如,在研究经济周期波动和经济增长时,他们不仅分析一定时期的投资和消费,而且还要分析一定时点上的资本存量和消费品存量,因为后者对于经济周期波动和经济增长同样起着重要作用。在研究一国经济发展程度和居民生活水平时,不仅要分析国民收入和国民收入增长率,而且还要分析国民财富和国民财富增长率。宏观经济学越来越强调采用存量分析方法,使之与流量分析方法并重,并且着手用统计学来解决存量统计中的问题,这是当前宏观经济学的又一个明显的发展趋势。

六、经济模型方法

在宏观经济学的分析中,建立和运用经济模型已经成为越来越普遍的分析方法。由于社会经济生活的复杂性,分析的困难可想而知,如果经济学家们能够借鉴

自然科学家们的分析方法,排除一些不必要的因素或者固定某些分析中暂时不涉及的因素,只分析一些最主要的因素,那将是十分有利的。在这一思路下,经济学家们把最主要的经济因素之间的联系通过理论和数学手段或者逻辑手段建立起来,从而形成他们进一步分析的工具。这就是所谓的经济模型的分析方法。这种方法的最大好处是比较简化和易于操作。

从西方经济学发展的历史上看,古典经济学家们就已经开始尝试运用这一方法了。现代经济学家们更是把这种方法加以大力推广,形成了不涉及经济模型方法就无法进行经济学研究和经济学交流的状况。现在,从某种意义上说,经济学家的理论探讨和比较都是在经济模型基础上展开的,甚至直接就是对经济模型本身的探讨。

一般说来,经济模型的分析方法主要包括:经济模型的建立,经济模型有效性的理论检验和经验检验和经济模型的运用。其步骤大致是:第一,提出需要研究的问题;第二,选择已有的经济分析模型或者建立新的经济分析模型;第三,以该模型对经济现象进行描述,以期得出其是否可用的初步结论;第四,由该模型分析得出初步结论;第五,以现实数据进行必要的计量检验和分析;第六,决定其分析结论是否正确,并对其进行完善性补充和修改。

总之,一个经济模型的好坏,主要取决于:其前提假定是否合理?是否易于操作和理解?是否可以对其分析结果进行经验性检验和验证?能否对经济变动的结果做出较准确的预测?了解了经济模型分析方法的这些特征,我们就能够更容易地理解有关的宏观经济学理论和分析了。

第三节 宏观经济学的产生和发展

从狭义角度来说,现代宏观经济学作为经济学中的一个重要分支,是20世纪30年代中期正式产生的。但是,从广义角度来说,宏观经济学的一些思想很早就有了。

一、早期的古典与新古典的宏观经济理论

关于宏观经济理论的思想渊源可以追溯到早期的古典经济学时代,17世纪中期以后,一直到19世纪70年代,是欧洲经济学的古典经济学时代。威廉·配第在17世纪60年代所著的《赋税论》中,就已对人口、财产和劳动收入同一国财政收支的关系进行了理论上的考察。后来他不仅分析了国民财富的构成,对不同国家的国民财富的差异作了比较,而且还对英国国民收入进行了第一次估算。古典经济学家们研究的重点是在市场自由竞争条件下经济活动的规律和增进国民财富的途径。但是,他们也同时研究了有关的宏观经济问题。资产阶级古典经济学的创建

者亚当·斯密在 1776 年出版的《国民财富的性质和原因的研究》一书中通篇以国民财富如何增长为主线,在研究劳动分工、生产专业化和市场调节机制引导资源配置的基础上,从宏观经济的角度论述了一国经济如何通过国际分工与贸易增进国民财富和福利的问题,较系统地分析了国民财富的性质和国民财富增长的条件,以及促进或阻碍财富增长的原因。因此该书也被认为是第一部具有深远影响的“宏大的动态学”,是宏观经济理论的先驱之作。法国重农学派创始人魁奈以《经济表》为中心,建立了国民经济活动的模型,对社会资本的再生产和流通作了较深刻的分析,分析和研究了宏观经济部门之间的联系、平衡问题和社会再生产问题。从而在经济思想史上最早系统地从宏观角度考查国民经济的全貌,这是重农学派对宏观经济理论所做出的重大贡献,因此,西方经济学界有人把魁奈称作凯恩斯式宏观经济学的先驱。

亚当·斯密经济思想的继承者英国古典政治经济学的完成者大卫·李嘉图在 1817 年出版的《政治经济学及赋税原理》一书中,以劳动价值论和分配论为基础,分析了工资、地租和利润之间的分配关系的变化及其对财富增长的影响,从而考查了国民财富的增长问题、总收入与纯收入问题。他还对货币流通量与物价水平变动之间的关系进行了研究,认为无限兑现的银行券的过度发行会造成银行券贬值,从而引起物价上涨和英镑汇价下跌。这个问题正是宏观经济学所要考察的重要课题之一。

19 世纪 70 年代至 20 世纪 30 年代是新古典经济学的时代。新古典经济学家们基本沿袭了古典经济学家侧重研究微观经济问题的倾向。但是,从 19 世纪晚期开始,随着资本主义从自由竞争阶段向垄断阶段的过渡,出现了频繁的经济危机。为了解释经济危机的原因,宏观经济研究进入了一个新的发展阶段。一些经济学家开始对整个国民经济活动进行研究,当时主要集中于对经济周期波动的解释上。

瑞典经济学家缪尔达尔和林达尔等人在 20 世纪 20 年代末开创性地采取总量分析方法考察资本主义国民经济的运动。他们的宏观经济理论的特色是把总量分析与动态的过程分析结合在一起,形成了宏观动态均衡理论。德国历史学派则从本国的民族立场提倡国家对经济生活的较多干预,从宏观角度强调经济发展的问题。美国经济学家米契尔对国民收入及其变动的研究是同对经济周期的分析紧密联系在一起。美国的制度学派则从更加广阔和综合的角度提出宏观经济问题。

宏观经济理论发展的另一支是 20 世纪初期英美两国的一些经济学家关于货币流通数量与物价水平相互关系的研究,他们开始将眼光逐渐转向宏观经济问题。在英国的代表人物是马歇尔和庇古,在美国的主要代表人物是欧文·费雪。费雪在他于 1911 年出版的主要著作《货币的购买力》中提出了著名的货币“交易方程式”。庇古则从货币问题和福利政策问题入手提出了“剑桥方程式”。1930 年以前,凯恩斯正是从剑桥方程式出发,提出自己的货币理论的。瑞典的威克塞尔则进一步将

货币问题和实际经济问题结合起来,提出了关于宏观经济波动和协调的理论和比较新颖的财政理论。马歇尔还强调了资本家的储蓄和投资以及企业家的经营管理活动在经济增长中的作用,从而把资本主义经济增长归功于资本家的节约和勤劳。他们的这些努力都为 20 世纪 30 年代中期以凯恩斯理论为标志的现代宏观经济学的出现开辟了道路和奠定了基础。这一时期并没有宏观经济学这一范畴,但是提出了一些研究宏观经济运行的理论和政策。

二、凯恩斯主义宏观经济学的创建、形成和完善时期

这是指从 1936 年凯恩斯《就业、利息和货币通论》发表到 20 世纪 70 年代之前的时期。这一时期也可以分为两个阶段。第一阶段为凯恩斯革命与现代宏观经济学的建立时期,其代表著作为凯恩斯的《就业、利息和货币通论》。第二阶段为凯恩斯主义宏观经济学的发展完善时期,其代表著作为萨缪尔森的《经济学》,包括萨缪尔森、R. 哈德、希克斯(John Hicks)、A. 汉森(A. H. Hansen)的新古典综合派(new classical synthesis school)对凯恩斯主义宏观经济学的发展和完善。

现代宏观经济学的产生和当时严重的经济大萧条和经济危机的背景紧密相联。尽管从 19 世纪下半叶开始,欧美国家就经常发生经济萧条和危机,但是,1929~1933 年的大萧条和大危机是最为严重的。据统计,在这一期间,美国的经济下跌了将近 50%,德国下跌了大约 40%,法国下降了近 30%,英国下降了大约 10%。在经济大萧条期间,这些国家也经历了史无前例的通货紧缩。当时,英国物价下降了将近 25%,德国和美国物价下降了 30%,法国物价下降了 40%。然而,最严重的问题还在于特大规模的失业。1933 年,美国的失业率达到了 25%,德国、法国、英国的失业率也出现了灾难性的上升。经济大萧条打破了长期以来人们所信奉的市场调节机制完美性的信条。传统经济理论观念和政策主张在经济大萧条面前一筹莫展、无能为力,这使得传统的经济理论发生了信任危机,严酷的现实迫切要求有新的经济理论来解释和解决现实经济问题。

凯恩斯在 1936 年出版的《就业、利息和货币通论》是现代宏观经济学正式产生的标志,其中的重要思想和观点被称为“凯恩斯革命”。凯恩斯在该书中提出了一个较为完整的宏观经济分析理论框架。他以解决就业问题为主要目标,通过有效需求理论的分析,说明有效需求对社会总产出和总就业的决定性作用,以及有效需求不足怎样导致经济失调和失业的增加,最后得出了资本主义市场自动调节机制无法有效解决大规模失业问题的结论。他指出,只有借助于国家对经济生活的“总揽”和干预,才可能提高有效需求水平,克服经济萧条,达到充分就业。现代宏观经济学与以前的宏观经济分析的一个显著的不同点在于:它所研究的是国民收入的变动及其与就业、经济周期波动、通货膨胀等的关系,因此,它又被称作收入分析。在该书中,凯恩斯提出了“边际消费倾向递减”、“资本边际效率递减”和“流动性偏

好”三个心理规律,将货币问题与实际经济问题结合起来,从而克服了传统经济理论将货币与实际经济活动分开的“两分法”。凯恩斯首次在宏观经济分析中涉及到商品市场、货币市场和劳动市场,并把三个市场结合起来。凯恩斯也首次强调了宏观经济政策,特别是赤字财政政策对于克服经济衰退、保持充分就业的重要意义。凯恩斯为现代宏观经济理论和分析方法的发展开辟了一条重要的道路。凯恩斯的这些观点,被认为是经济学史上的第三次革命——凯恩斯革命。这次革命是革了新古典经济学的命,主要提出了以国民收入决定为理论中心,以国家干预为政策基调的现代宏观经济学体系。

然而凯恩斯的《就业、利息和货币通论》只是为宏观经济学的发展提供了一个新的起点。在20世纪30年代空前严重的经济危机条件下,凯恩斯这一时期主要关心的是如何消除大规模失业的问题。因此他认为进行短期的、比较静态的总量分析就可以达到这一目的了。然而在凯恩斯的追随者看来这样一种短期的、比较静态的总量分析显然是不够的。从30年代末起,他们主要从三个不同方面补充和发展了凯恩斯的宏观经济学。这就是投资函数理论的发展,包括各种经济增长模型的出现;消费函数理论的发展和从封闭经济模型发展为开放经济模型。

从20世纪50~60年代末是凯恩斯主义发展时期。在这一时期凯恩斯主义得到了广泛的发展。西方各国都加强了对经济生活的全面干预。战后,由于美国经济学家的努力,凯恩斯的经济学开始逐渐成为美国经济学的主流。以美国经济学家萨缪尔森为首的一些经济学家把凯恩斯主义的宏观经济学与新古典经济学的微观经济学结合在一起,形成了新古典综合派。新古典综合派对各国经济理论与政策都产生了重大影响。在英国,则以“新剑桥学派”为主要代表。这一时期,经济学家们普遍接受了凯恩斯的宏观经济学的分析和主张,认为社会总产出和总就业的波动主要是由总需求的波动引起的,所以,经济学家们的主要任务就应该是研究在一般情况下如何通过控制总需求来稳定经济、防止波动,而在经济出现衰退时,怎样提高总需求水平,促进经济复苏,增加就业和产出。这一时期,需求导向的宏观经济分析成为宏观经济学的主流,也成为经济实践的主流。

三、非凯恩斯主义宏观经济学形成和发展时期

在凯恩斯主义宏观经济学产生和发展起来以后,非凯恩斯主义宏观经济学虽然仍旧平行地发展着,但其影响要小得多。这种情况在20世纪60年代以后,特别是70年代以后有了很大的变化。20世纪70年代到80年代中期被称为自由放任思潮的复兴时期。这一时期也是现代宏观经济学的理论大论战时期,是凯恩斯主义宏观经济学遭受挫折与批评,以及凯恩斯主义经济学的反对派活跃的时期。在第二次世界大战结束后到70年代初这段时间,凯恩斯主义的理论和政策主张在西方国家日益盛行。在国家对经济生活的全面干预时,一方面促进了经济的巨大发