

普通高等教育“十二五”规划教材

宏观经济学

HONG GUAN JING JI XUE

主编◎王阳



中国工商出版社

普通高等教育“十二五”规划教材

宏观经济学

主 编 王 阳

副主编 王 冰 王炳焕 闫 然

中国工商出版社

责任编辑 李富民

封面设计 可可工作室

图书在版编目(CIP)数据

宏观经济学 / 王阳主编. — 北京 : 中国工商出版社, 2013. 7

ISBN 978-7-80215-638-8

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

中国版本图书馆 CIP 数据核字(2013)第 174348 号

书名/宏观经济学

主编/王阳

出版·发行/中国工商出版社

经销/新华书店

印刷/北京明兴印务有限公司

开本/787 毫米×1092 毫米 1/16 印张/20 字数/402 千

版本/2013 年 7 月第 1 版 2013 年 8 月第 1 次印刷

社址/北京市丰台区花乡育芳园东里 23 号(100070)

电话/(010)63730074, 83610373 电子邮箱/zggscbs@163.com

出版声明/版权所有, 侵权必究

书号: ISBN 978-7-80215-638-8/F·834

定价: 38.00 元

(如有缺页或倒装, 本社负责退换)

前言

中国改革开放至今已有 35 年的历史,在这个过程中我们积累的经济数据很全面,对经济理论如何应用却不明确,但可以确定的是宏观经济问题在中国很复杂,而且问题繁多。比如常常被提及的就业,收入分配,经济发展等问题。如此,制定的宏观经济政策就显得尤其重要,因为它直接影响人们的日常经济决策,政策的制定来源于政策建议,而这些政策建议的由来依据就是经济理论,在众多政策建议中鉴定检验,并且筛选也是需要理论依据的。所以理论研究的意义就在于政策制定时能够给与一个大致方向和指引。我们也可以看到,宏观经济学到目前为止,发展很快,直觉的判断越来越重要,技术上的处理和数学应用只能被认为是工具,虽然是必经过程,但不是最后的目的。理论学习是必经阶段,注重经济学知觉的培养,学习宏观经济学的最终目标是要培养直觉的看法。

宏观经济学本身是一门充满了争议和不同观点的学科,至今没有形成一个公认的、统一的理论体系,所以编写宏观经济学教材的难点在于如何确定一个合适的理论体系。传统的凯恩斯理论体系中,宏观经济学和微观经济学内在似乎缺乏某种逻辑联系,而缺少了微观基础的宏观经济学研究似乎就变成了无源之水或者仅是空中楼阁;但是如果纯粹按照古典理论出发,在微观理论的基础上推导宏观经济理论,宏观经济学似乎又没有存在的必要。如何把两者统一,把不同理论学派的观点统一在一个理论框架中又不显得凌乱,这是个难题!本书力图做到如此。

本教材是全国普通高等教育应用型本科“十二五”规划系列教材之一,属于以应用型本科财经类专业为主的、多专业必修的一门专业基础课适用教材。

目前国内使用的教材多参考萨缪尔森的《经济学》和曼昆的《经济学原理》两本书的体系和风格,本书也如此。但本书在此基础上更多结合我国自身的特点,揉入了我国近几年的经济案例,希望在阅读本书理论知识的同时结合我国经济的特点有更多的思考,这也使本书变得更加实用。本书主要有三大特点:

第一,内容新颖、全面。本书基本涵盖目前国内外宏观经济学最新的基础前沿理论,并且做到简练、明确。如消费理论、就业理论、通货膨胀理论和对宏观经济学的全面评价等。

第二,紧扣中国国情。在教学实践中很多同学反映宏观经济学距离现实太远,太抽象,本书紧密结合中国宏观经济的背景,时刻把握理论与实践的结合,使同学在理解抽象理论时做到本土化。

第三,实用性强。本书在每章开头引入案例,使学生对本章内容有定性的了解;在大部分章节中也有相应材料供同学们扩展知识空间;在每章结尾有对应案例供学生思考和分析。

目 录

第一章 导 论	(1)
第一节 宏观经济学概述	(2)
第二节 宏观经济学的基本假设和研究方法	(7)
第三节 宏观经济学的理论体系	(10)
第二章 国民收入的衡量	(13)
第一节 国民收入的核算	(13)
第二节 国民收入核算中的其他总量指标	(25)
第三节 国民收入的循环模型及储蓄——投资恒等式	(30)
第三章 消费与储蓄理论	(41)
第一节 凯恩斯宏观经济模型与古典宏观经济模型的区别	(41)
第二节 凯恩斯的消费函数与储蓄函数	(43)
第三节 消费理论的发展	(51)
第四章 投资与货币理论	(60)
第一节 投资理论	(60)
第二节 货币供给理论	(66)
第三节 货币需求	(73)
第五章 简单国民收入决定模型	(81)
第一节 均衡产出	(81)
第二节 两部门经济中国民收入的决定	(85)
第三节 三部门经济中国民收入决定	(90)
第四节 四部门经济中国民收入的决定	(95)
第六章 产品市场和货币市场的一般均衡:IS—LM 模型	(101)
第一节 IS 曲线	(102)
第二节 LM 曲线	(105)
第三节 IS—LM 模型	(112)
第七章 总需求—总供给模型:AD—AS 模型	(121)
第一节 总需求曲线	(123)
第二节 总供给曲线	(125)



第三节 总供给曲线模型及对经济的解释	(128)
第四节 AD—AS 均衡	(132)
第八章 宏观经济政策	(144)
第一节 宏观经济政策概述	(145)
第二节 需求管理政策	(147)
第三节 需求管理政策分析	(153)
第四节 供给管理政策	(165)
第九章 开放的宏观经济模型:IS—LM—BP 模型	(173)
第一节 汇率理论	(174)
第二节 国际经济部门的作用	(181)
第三节 开放经济下的 IS—LM—BP 模型	(190)
第四节 IS—LM—BP 模型的应用	(195)
第十章 失业与通货膨胀理论	(202)
第一节 失业概述	(203)
第二节 失业的解释	(209)
第三节 失业的治理	(214)
第四节 通货膨胀理论	(215)
第五节 失业与通货膨胀的关系	(226)
第十一章 经济周期和经济增长理论	(237)
第一节 经济周期及其类型	(237)
第二节 主要经济周期理论	(239)
第三节 经济增长的含义与源泉	(247)
第四节 经济增长因素的分析	(249)
第五节 主要经济增长模型介绍	(253)
第十二章 宏观经济学的发展展望	(266)
第一节 宏观经济学发展史	(267)
第二节 宏观经济学流派	(273)
第三节 当代西方宏观经济学发展中的争论与共识	(301)
第四节 当代西方宏观经济学的发展展望与反思	(308)

第一章 导论

案例导入：宏观经济学与微观经济学的分离

从亚当·斯密时期到20世纪30年代,许多经济学家都在致力于微观经济学领域的理论研究,经济学家们的研究范围涉及贸易和交换、理性又信息灵通的消费者与追求利润最大化的企业、垄断和新科技等问题,他们集中研究不同的市场是如何运作的。但是从20世纪30年代开始,情况就有所改变,因为在这个时期发生了全球性的经济危机,使世界各国的经济陷入瘫痪。在1933年,美国的经济萎缩了30%,失业率高达25%。1939年,即第二次世界大战前夕,失业率仍居高不下,高达17%。从此以后,经济学家们才开始研究是什么因素决定了失业率和GDP这样的总量指标。

现在,即使并不从事经济学研究的人也知道“微观经济学”和“宏观经济学”的大致区分。然而,直到20世纪30年代经济学家们才开始考虑如何进行这样的划分。1933年,著名的挪威经济学家拉格纳·弗里希首次清楚地提出了这两个名词在现代意义上的概念。他这样写道:“微观分析方法是指对于大的经济体系中的某个经济单位在一般条件下的行为进行研究分析的方法,而宏观分析方法是指对整个经济系统的总体分析。”约翰·梅纳德·凯恩斯也曾于1936年提出了类似的概念:“我认为,经济学理论应划分为两个部分,一个部分是研究单个产业或公司在给定条件下的产出和利润的理论,另一部分是研究整个经济的产出和就业的理论。”

但是这两位杰出的经济学家都未使用“微观经济学”和“宏观经济学”这样的字眼。首次使用这两个名词的是一位在荷兰统计研究所工作的不知名的经济学家,名叫彼得·沃尔夫,1941年,沃尔夫在文章中这样写道:“微观经济学描述的是关于个人或家庭的经济关系,而宏观经济学是研究一个大的群体(例如国家或整个社会阶层)相互间的关系。”

20世纪60—70年代,许多经济学家已认识到宏观经济学的研究方法和微观经济学的方法相去甚远。然而,十分有趣的是,最近20年以来的一些最重要的经济学文献,则开始寻求一些方法来打破宏观经济学和微观经济学之间的鸿沟,研究理性且信息灵通的消费者和追求利润最大化的企业如何一起对失业、通胀和经济增长的波动产生影响。

(资料来源:Hal R. Varian. "Microeconomics", The new Palgrave: A Dictionary of Economics, London and New York: Macmillan and Stockton, 1987(3): P461—463)

凯恩斯主义经济学是基于凯恩斯1936年的著作《就业、利息和货币通论》思想的经济理论,主张国家采用扩张性的经济政策,通过增加需求促进经济增长,即扩大政府开支、实行财政赤字、刺激经济和维持繁荣。凯恩斯的经济理论认为,宏观的经济趋向会制约个人的特定行为。18世纪晚期以来的“政治经济学”或者“经济学”推行通过不断发展生产从而增加经济产出,而凯恩斯则认为对商品总需求的减少是经济衰退的主要原因。由此出发,他认为维持整体经济活动数据平衡的措施可以在宏观上平衡供给和需求。因此,凯恩斯和其他建立在凯恩斯理论基础上的经济学理论被称为宏观经济学,以与注重研究个人行为的微观经济学相区别。



第一节 宏观经济学概述

“宏观经济学”是理论经济学或基本经济理论的一个重要方面,它和“微观经济学”的提法相对应。“宏观”具有宏大、总体、整体或综合的含义,“微观”具有微小、个体的含义。很多人都知道具备一些经济学知识和常识的重要性,他们从自己的切身体验中感受到,当自己的经济利益受到影响时,学一些相关的经济知识对他们有重要帮助。也许有人认为,只有和自己的具体经济活动相关的经济知识(如微观经济学的知识)才是最重要的,其他知识,特别是宏观经济学的知识,应该是国家或政府决策者们考虑问题时用到的,离自己较远。实际上这种认识是片面的。请回想一下,2008年,在美国次贷危机的冲击下,有关各国或地区中,谁又能够完全避免其冲击和影响呢?我们还可以再回想一下,当整个经济不景气时,自己的企业是否能够完全置身事外,不受影响呢?再比如说,当政府出台一项全国性的税收政策,或者决定调整存贷款利率时,自己的企业或自己的个人利益是否也能不必作出适当调整而能维持原状或进一步增进呢?显然,在上述情况下,个人的或企业的利益必然受到经济大形势和大环境的重要影响。有些情况下,在对整个经济形势和动向有所了解的基础上,个人或企业可以经过对自身行为的适当调整,尽可能地减少损失或增加收益。但是,在某些情况下,由于缺乏对整个经济形势和动向的了解,个人或企业无法作出相应的调整,就只能听任外来冲击的不利影响。实际上,宏观经济环境的变化对企业和个人经济利益的影响还不止这些,如果宏观经济环境的变化涉及企业和个人经济利益的战略性调整,其影响就会更大。可见,宏观经济学的知识对于企业和个人同样是至关重要的。

为了进一步了解宏观经济学,我们对宏观经济学的研究对象以及与微观经济学的关系和宏观经济学的发展史作进一步的说明。

一、宏观经济学研究的主要问题

过去100年间为什么一些国家收入迅速增长而另一些国家仍然陷入贫困之中?为什么一些国家通货膨胀率高而另一些国家却维持了物价稳定?为什么所有国家都经历了衰退和萧条——反复出现的收入减少和失业增加的时期,而政府的政策应如何降低这些事件发生的频率和严重程度?宏观经济学正力图回答这些问题以及许多相关的问题。

只要读读报纸或听听新闻就可以评价宏观经济学的重要性。我们每天都可以看到收入增长放慢,美联储着手对付通货膨胀,或者在对衰退的担忧中股市下跌这类标题,虽然这些宏观经济事件也许看来是抽象的,但它们与我们的生活却息息相关。预测对自己产品需求的企业经理必须猜测消费者的收入增幅;依靠固定收入生活的老年人很想知道物价上涨会有多快;临近毕业的大学生要找工作也希望经济繁荣,企业会雇佣他们。

由于经济状况影响每一个人,因而,宏观经济问题在政治争论中起着中心作用。选民敏锐地意识到经济状况如何,也知道政府政策可以以有力的方式影响经济,因此,现任总统在经济状况好时支持率上升,而在经济状况差时支持率下降。在1992年大选期间,克林顿的首席战略顾问为了使竞选集中众关键问题上,在他自己的办公室里贴了一条标语“笨蛋,要谈论经济!”

宏观经济问题也是世界政治的中心。近年来,欧洲走向统一货币,许多亚洲国家经历了金融危机和资本外逃,而美国要通过大量向国外借贷来为巨额贸易赤字筹资。当世界各国领导人开会时,这些问题往往在议事日程中排在显要位置。尽管制定经济政策的工作落在世界各国领导人身上,但解释整体经济如何运行的工作却落在宏观经济学家身上。为了达到目的,宏观经



济学家收集不同时期和不同国家有关收入、物价、失业和其他许多相关变量的数据。然后,他们力图形成有助于解释这些数据的一般性理论。像研究行星演变的天文学家和研究物种进化的生物学家一样,宏观经济学家也不能进行受控实验;相反,他们必须利用历史给予的数据。宏观经济学家观察不同国家的经济,以及这些经济随时间推移而发生的变化,这些观察既促进了宏观经济理论的发展,又提供了检验这些理论的数据。

的确,宏观经济学是一门年轻而不完善的学科。宏观经济学家预测未来经济事件状况的能力并不比气象学家预测下一个月天气的能力强。但是,宏观经济学家对经济运行相当熟悉,宏观经济学的知识既有助于解释经济事件,又有助于政府形成经济政策。

每一个时代都有自己的经济问题。20世纪70年代,理查德·尼克松、杰拉尔德·福特和吉米·卡特这些总统都竭力制止通货膨胀率上升而一无所获。20世纪80年代,通货膨胀率降下来了,但罗纳德·里根和乔治·布什这两位总统对巨额联邦预算赤字一筹莫展。20世纪90年代,当比尔·克林顿入主白宫时,预算赤字减少了,甚至还略有预算盘余,但联邦税收在国民收入中的比例却达到了历史高位。显然在这几十年间出现经济学的基本原理并没有变,但宏观经济学家应该具有创造性地运用这些原理来应付变化的情况。

简而言之,宏观经济学主要研究整体经济,以产出、失业、通货膨胀这些大范围内的经济现象为研究对象,通过对经济中各有关总量的决定和变化的研究来说明一国经济如何实现经济持续增长、充分就业、价格稳定和国际收支平衡的目标。其目的是对产出、失业以及价格的变动作出经济解释,对社会福利的影响和政府政策可能发挥的作用进行分析。

阅读材料 1-1:天才凯恩斯

约翰·梅纳德·凯恩斯(John Maynard Keynes, 1883—1946),宏观经济政策的每一个课题的讨论几乎都必须从他开始。因为凯恩斯对经济学做出的极大贡献,一度被誉为资本主义的“救星”、“战后繁荣之父”。他以财政政策和货币政策为核心的思想后来成整个宏观经济学的核心,甚至可以说后来的宏观经济学都是建立在凯恩斯的《通论》的基础之上的。毫无疑问,凯恩斯是一个伟大的经济学家,他敢于打破旧的思想的束缚,承认有非自愿失业的存在,首次提出国家干预经济的主张,他的这种经济理论影响了几代人,在目前的经济政策制定中仍然起着举足轻重的作用,并将继续影响未来若干年的经济思想。

凯恩斯的成就,与他的背景和个性有关。凯恩斯的父亲(内维尔)是剑桥经济学家和逻辑学家,母亲(佛罗伦丝)也是剑桥毕业生,曾任剑桥市长,因此,他在青少年时代就有机会同一些经济学家和哲学家接触,并结识一些有文艺才能和创新精神的朋友。他后来进入剑桥大学专攻数学,以优异成绩毕业,后到剑桥国王学院任经济学教师。第一次世界大战爆发后被征召进财政部工作,曾以英国财政部首席代表身份参加巴黎和会并因对德国赔款问题的意见未被接受而忿然辞职回到剑桥。凯恩斯长期担任权威刊物《经济学杂志》的主编,先后出版过几本名著,从事证券投资获利数十万英镑,兼任不少公司的顾问或董事,开办过艺术剧院,担任过皇家学院总务长,并娶了一位俄国最著名的芭蕾舞演员。“二战”期间凯恩斯担任了英国财政部顾问,是英国战时经济政策的主要制定者。战争结束前后,又忙于英美贷款谈判和布雷顿森林会议等一系列活动。

多年以来,关于凯恩斯的学术思想及其影响的争论一直没有偃旗息鼓,关于他的赚钱技巧和艺术修为如何高妙的传言可谓神乎其神。而诚如他的夫人莉迪娅·卢波科娃所说,他“不仅仅是个经济学家”,他不但开辟了宏观经济学的研究阵地(他的两本主要著作给他带来了巨大且历久不衰的声誉),在数学、哲学、文学等领域也有若干建树,而这些领域也对他思考经济学和经



济问题的方法产生了影响。比如,尽管大多数经济学家都致力于“做至善的事情”,很少有人把伦理学当成一回事。然而凯恩斯坚持认为,经济发展只有在它能够使人们在道德上得到改善时,才算是正当的事业。从某种程度上讲,经济学和伦理学应当携手并进。但当人们的收入水平超出一定的标准时,经济学和伦理学就开始分道扬镳。凯恩斯对西方出现的消费主义浪潮,文化和精神价值成了“酷爱金钱”的牺牲品这种现象一直非常不快。哲学方面,凯恩斯是一位直觉主义者,相信人们对善与恶、真理与谬误、对与错的行为有直接的、先验的认知。从个性上看,凯恩斯具有审美家和管理人才的双重性格。他的情趣和爱好是唯美的;他的经济学佳作都有一种诗意,但这些艺术火花是为保卫受到威胁的社会秩序这个任务服务的。他常常愿意牺牲他认为正确的东西,以换取他认为可以得到的东西。他意识到:“文明是少数几个人的个性和意志建立起来的一种单薄、脆弱的外壳。人们只能通过巧妙地制定和不择手段地维护规则和习俗来维持文明。”他之所以能够继续引起我们的注意是因为他正是属于那“少数几个人”之一,他将自己的一生和思想贡献给了捍卫“单薄、脆弱的”文明外壳的事业。

二、宏观经济学和微观经济学

宏观经济学研究的经济规律不是微观经济行为和规律的简单加总。有时,宏观经济学规律与微观经济学规律截然相反。比如,1970年诺贝尔经济学奖获得者、英国经济学家保罗·安·萨缪尔森在其著作《经济学》中举了一个例子来说明宏观规律与微观规律的不同:当一群人在观看马路上的游行时,如果某人把脚跟起来,他可以看得更清楚些——这是微观规律。但如果大家都踮起脚来看,则谁也不会比原来看得更清楚——这是宏观规律。

具体说,宏观经济学和微观经济学关系如下。

1. 宏观经济学和微观经济学的区别

第一,研究对象不同。从性质上说,微观经济学的研究对象是单个经济单位的经济行为和决策方面的问题,如家庭、厂商等。正如美国经济学家J. 亨德逊(J. Henderson)所说,“居民户和厂商这种单个单位的最优化行为奠定了微观经济学的基础”;微观经济学是研究经济社会中个体如个别消费者怎样才能使其消费的效用达到最大化,个别厂商如何才能使其生产要素的配置达到最优化或者使其利润达到最大化的问题,个别市场上均衡产量和均衡价格是如何形成或决定的问题等。微观经济学就是要通过对于这些问题的研究,达到提高经济资源运用者的资源配置效率的目的。

而宏观经济学是研究经济中的总量问题和总体性问题,如商品和服务的总产量、社会总收入的增长、社会的通货膨胀和失业问题、国际收支的平衡问题、经济的繁荣和萧条问题等。在对上述这类问题的研究中,宏观经济学的重点是围绕着短期经济波动和长期经济增长展开的。宏观经济学就是要通过对于这些问题的研究,达到提高经济资源运用整体效率的目的。这些与微观经济学研究的对象是完全不同的。

第二,解决的问题不同。微观经济学把资源有效利用作为既定的前提,解决的是资源配置问题,即生产什么、如何生产和为谁生产的问题,以实现个体效益的最大化。宏观经济学则把资源配置作为既定的前提,研究社会范围内的资源利用问题,以实现社会福利的最大化。

宏观经济学的分析和研究,完全超越了微观经济学中对于经济行为个体、局部和细节的关注。它忽略了经济生活中极其复杂的细节问题,将其抽象化和一般化为一些易于把握的基本问题,再分别从整个产品市场、货币市场、劳动市场和国际大市场的角度加以分析,从这些基本问题在整个国民经济中的相互作用和地位进行研究。由于这种特点,宏观经济学也许不能对厂商



和消费者遇到的具体问题给出明确答案,但是,却可以对国民经济中的一些重大问题作出较为可信的解释,比如一国经济在某一时期出现繁荣或衰退的原因、经济中物价水平变动的原因、国际收支不平衡的缘由等。

第三,研究方法不同。微观经济学的研究方法是个量分析,即研究经济变量的单项数值如何决定。宏观经济学的研究对象则是整个经济,研究整个经济的运行方式与规律,从总量上分析经济问题。正如萨缪尔森所说,宏观经济学是“根据产量、收入、价格水平和失业来分析整个经济行为”的。美国经济学家 E. 夏皮罗 (E. ShaPiro) 强调“宏观经济学考察国民经济作为一个整体的功能”。这些总量包括两类:一类是个量的总和;另一类是平均量。因此,宏观经济学又被称为“总量经济学”。

第四,基本假设不同。微观经济学的基本假设是市场出清、完全理性和充分信息,认为“看不见的手”能自由调节以实现资源配置的最优化。宏观经济学则假定市场机制是不完善的,政府有能力调节经济,通过“看得见的手”纠正市场机制的缺陷。

微观经济学研究、分析的中心问题是个别价格的变化问题,而整体的价格水平被认为是既定的。但是,在宏观经济学中,个别价格的决定与变化问题恰恰不是分析的中心问题,而整体价格水平的决定和变化问题却是研究的重要方面。此外,微观经济学中会把收入变量作为既定因素,而宏观经济学中,国民收入和支出总水平的变化恰恰是关键性变量。微观经济学中总是把充分就业作为既定变量,但宏观经济学中往往把就业问题作为重要的研究对象。在微观经济学中会把政府假定为外生的、与分析无关的,但在宏观经济学中,却认为政府是一个重要的行为主体,政府的财政预算、国债等都是重要的经济变量,都是宏观经济学要研究的重点问题。

第五,中心理论和基本内容不同。微观经济学的中心理论是价格理论,宏观经济学的中心理论则是国民收入决定理论。

2. 宏观经济学和微观经济学的联系

一般说来,尽管宏观经济学和微观经济学的侧重点不同,有明显的区别,研究的方法也有所不同,但是在它们各自的研究中却是互相关联的,是互以对方为既定条件的。没有各个微观变量,宏观总量就失去了相加的基础;失去了宏观经济的大环境和总体趋势,微观分析结果的意义也可能大不一样,所以,宏观经济学要以微观经济学为基础,微观经济学又要以宏观经济学为既定条件。另外,宏观经济学和微观经济学在根本目标方面也有一致性,双方都是要实现社会福利的最大化。只不过微观经济学是通过市场自动调节机制,借助于对个别厂商和消费者最优化行为的分析,达到整体经济最优的均衡结果,而宏观经济学则从整体上抓住最重要的问题进行调节和控制,并借助于政府的经济政策使人们的福利尽可能地达到最优化或者最大化。

所以从总体说,宏观经济学和微观经济学只是从不同角度对经济现象进行分析,采用的都是实证分析方法,即都把社会经济制度作为既定的,不涉及制度因素对经济的影响,从而与制度经济学区分开来;同时,微观经济学先于宏观经济学产生,发展得比较成熟,因而是宏观经济学的基石,两者互相补充、互相渗透,共同组成了经济学的基本原理。此外,宏观经济学和微观经济学在研究方法上,也有很多一致性和相似性。比如,双方都运用均衡分析方法、供求分析方法、弹性分析方法和经济模型分析的方法等。

3. 宏观经济学的微观基础

之前的宏观经济理论,无论是凯恩斯主义还是货币主义,都把微观经济理论所探讨和得出的某些原理当做既定的前提加以接受,但诸如价值形成问题、收入分配的依据问题等并不包括在他们的理论之中。也就是说,宏观经济学一直缺乏自己的微观经济学基础,寻找微观基础一



直是宏观经济理论研究者孜孜以求的工作。

所以尽管建立宏观经济学与微观经济学的桥梁并非易事,但不少经济学家坚信:出于整体经济(宏观经济)是单个经济活动(微观经济)的总和,因此,作为研究整体经济的宏观经济理论必然以研究单个经济的微观经济理论为基础。但关于宏观经济学的微观基础问题,一直是学界激烈争论的问题。目前,多数经济学家达成了一种共识:只有把宏观经济总量作为单个经济当事人寻求最大化的结果来解释,宏观经济总量关系只有建立在微观基础之上时,宏观经济的推理才是可靠的。

下面介绍几种学派对宏观经济学微观基础的观点。

(1)针对凯恩斯主义宏观经济学缺少价格和工资黏性的微观基础,新凯恩斯主义者从区分名义黏性和实际黏性开始进而解释这种黏性产生的原因及其宏观经济意义。名义黏性的宏观经济含义是,总需求变化引起物价水平缓慢和较小的变化,引起产出较大的变化;实际黏性的宏观经济含义是,在劳动市场上,对劳动需求的变化导致实际工资的较小变化和就业量的较大变化。在商品市场上,对商品需求的变化大部分表现在产出的变化上;只有小部分表现在毛利润的变化上。由于价格和工资黏性,经济从市场非出清的均衡状态恢复到市场出清的均衡状态有一个缓慢的过程,等待价格和工资下降的压力带来经济向上调整是一个长期的痛苦过程,因而刺激总需求是必要的,稳定的经济政策具有积极作用。这样一来,新凯恩斯主义者认为,他们的政策主张就建立在微观分析的基础上了。

对于凯恩斯宏观经济学的微观基础问题,主要有两种看法:其一,萨缪尔森早就提出,用新古典经济学的微观理论,即边际效用价值论和边际生产力分配理论作为凯恩斯宏观经济学的微观基础,因而被称为“新古典综合派”。其二,以卡尔多、琼·罗宾逊为首的凯恩斯主义者则认为,要从李嘉图的价值理论和分配理论中去寻找宏观经济学的微观基础,要承认价值本身有客观的、物质的基础,承认分配问题不能脱离特定历史条件和所有权因素来考察。凯恩斯经济学的微观基础问题,实际上是凯恩斯主义中两大分支——新古典综合派和新剑桥学派一之争,这个争论还在继续进行。

(2)对于货币主义宏观经济理论的微观经济学基础问题,从货币主义分离出的理性预期学派的经济学家,力图从微观经济学的市场出清和完全理性这两个基本假设出发来解释宏观经济问题,并建立一个统一的经济学体系。针对凯恩斯主义宏观经济学暗含的假定——经济当事人具有充分信息与完全理性,他们把分析的重点放在具有理性预期的公众行为上,分析这些经济当事人如何按照理性预期分析各种市场供求的变动、产量、价格和就业的决定,追求其利益最大化的行为。对于总量分析,他们从分析微观的经济行为和经济变量归纳和概括出宏观经济行为和宏观经济变量的变动关系。他们认为,这样就使得纯粹的宏观经济分析具有微观经济分析基础,从而建立了宏观分析与微观分析内在一致的逻辑关系。在这个方面,理性预期学派的经济学家做了许多努力,提出了一些理论,如真实经济周期理论中的传播机制和扰动理论,以及理性预期的一系列模型,这些理论对宏观经济学及其微观基础的研究产生了重要影响。

而货币主义者们尤其是所谓第二代通货膨胀研究者们对此进行了补充和发展。他们认为,人们预期的形成与市场信息之间存在着密切的关系,而市场信息的获得不仅需要成本,而且难以充分。因此,只分析宏观经济学领域中货币流通总量和利息率水平,而不分析微观经济学领域中人们对工资和价格的预期、市场信息的传递方式,显然是不够的。

(3)希克斯在宏观经济学和微观经济学结合的问题上走了一条独特的道路,既不同于凯恩斯主义,也不同于货币主义。早在1939年,他在《价值与资本》一书中就着手于二者结合的尝



试,在他的理论中,微观理论和宏观理论是一致的。希克斯从利率决定理论、IS—LM 分析、预期理论、刚性工资理论等方向论述了凯恩斯理论是微观经济学的一个特例,尽管其理论并未被大多数经济学家接受,但毕竟开创了宏观经济学微观化研究的先河。凯恩斯主义者在解释就业理论时,涉及劳动的供求和工资决定理论,其充分就业的宏观经济模型,正是建立在以完全竞争为假定前提的价格理论和工资理论的基础上的。

如何把微观经济学作为宏观经济学的基础问题仍在探索之中,至今也没有形成令人满意的答案。怎样通过有力的论证使微观经济学成为宏观经济学的基础,仍是一个需要进一步深入研究的问题。

第二节 宏观经济学的基本假设和研究方法

一、基本假设

假设是指在研究开始时提出的等待检验的命题,它构成了研究的主题。假设必须以前人的研究为基础,假设的目的是发现新知识。因此,假设的合理性主要体现在:一是假设必须建立在可靠的理论基础之上。任何假设都是现有理论的扩展和继续,不可能离开现有的理论去进行假设。二是假设必须清晰和具体地表述变量之间的关系。且假设必须是可以验证的,可以观测的。假设的类型包括:一是归纳型假设。在观测基础上通过对事实的概括来观测变量之间可能的关联,并给予初步的解释。二是演绎型假设。从公理、原理或者学说出发,运用逻辑推理提出假设。经济理论的研究往往要从一些假设前提出发,而这些假设前提又与现实中的情形存在一定的距离。因此,有的西方学者主张经济理论的“结论就不可能作为正确的而被接受”。一般来说,宏观经济学的基本假设有两种。

1. 资源有效配置

在市场机制能够有效配置资源的前提下来研究资源有效利用问题,在总量模型的基础上来研究失业、通货膨胀和经济周期问题。

2. 市场机制不完善

宏观经济学是以市场机制是不完善的和政府应该并可以调节经济为假设条件的。宏观经济学是在此假设条件下,以整个国民经济为研究对象,通过研究经济中各有关总量的决定及其变化,来说明资源通过政府的宏观经济政策才能得到充分利用的经济理论。

二、研究方法

宏观经济学的研究方法主要有总量分析,实证分析和规范分析,均衡分析和非均衡分析,静态分析、比较静态分析和动态分析、存量分析、流量分析和经济模型分析。

1. 总量分析

宏观经济学研究社会总体经济行为,因而不能像微观经济学那样运用个量分析方法,而要用总量分析方法,即从个量分析的加总中引出总量的分析方法。

宏观经济学在运用总量分析对经济问题进行考察时,与微观经济学一样,首先假定制度是已知、既定的,在这个前提下来对经济总量进行分析。这并不是宏观经济学家认为制度对经济不起作用而不重要,而是他们认为,不管制度对经济活动会产生什么样的影响,都不是宏观经济分析能够解决的,所以在进行数量分析时,可把这些作为既定的条件而不予以讨论。



宏观经济学运用总量分析,也广泛运用边际增量分析方法。所谓边际增量分析是指分析自变量每增加一单位或增加最后一单位的量值会如何影响和决定因变量的量值,比如边际消费倾向、资产边际效率等等。同时,还把经济变量区分为内生变量和外生变量。内生变量是指由经济模型内部结构决定的变量;外生变量是指不是由经济模型中的变量决定的,而是由外部因素(如政治、自然)决定的变量。

宏观经济学运用经济加总法时需要注意:有些总量变化可以从微观分析的个量中直接加总(大部分是加权平均加总)而得到,有时则不能把个体的经济做简单加总直接等同于整体经济变量。比如,个人或家庭勤俭持家、节约开支,当然会等于在实际上增加的收入,此即所谓“节流”与“开源”同义。但是,如果全社会的家庭都这么做,看起来会增加储蓄或收入,但实际上却不会增加全社会的储蓄和收入,而只会对社会造成不利的影响。因为全社会都增加储蓄就意味着全社会都减少了投资和消费,当社会的总需求量下降的时候,生产也会由于销售的困难而缩减,价格也会因此而下降,最终社会的总收入就会减少。当社会总收入减少的时候,储蓄当然也会随之减少。这就是宏观经济学所说的储蓄悖论。

2. 实证分析与规范分析

实证分析要回答“是什么”的问题,即排斥一切价值判断,只研究经济本身的内在规律,并根据这些规律分析和预测人们经济行为的效果。规范分析要回答“应该怎么办”的问题,即以一定的价值判断为基础。

既要说明事物本身是好还是坏,是否符合某种价值判断,或者对社会有什么意义,还要分析主体的行为,要求行为主体怎么做。因此,规范分析本身没有客观性,是以价值判断为基础进行研究的,它所得出的结论要受到不同价值观的影响。

实证分析与规范分析尽管有差异,但它们也并不是绝对相互排斥的。规范分析以实证分析为基础,实证分析则离不开规范分析的指导。

3. 均衡分析与非均衡分析

均衡原本是物理学中的名词。它表示,当一物体同时受到两个方向不同的外力作用且两种力量恰好相等时,该物体由于受力相等而处于静止状态,这种状态就是均衡。19世纪末的英国经济学家马歇尔把这一概念引入经济学中,主要是指经济学中各种对立的、变动着的力量处于一种力量相当、相对静止、不再变动的状态。

非均衡分析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非均衡来加以解释,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,非均衡分析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。微观经济学与宏观经济学中运用的主要分析工具是均衡分析。

4. 静态分析、比较静态分析和动态分析

与均衡分析密切相关的是静态分析、比较静态分析和动态分析。宏观经济学和微观经济学所采用的分析方法,从一个角度看是均衡分析,从另一角度看就是静态、比较静态和动态分析。所以,它们实际上是密不可分的整体。

静态分析就是分析经济现象的均衡状态以及有关的经济变量达到均衡状态所需要具备的条件,它完全抽象掉了时间因素和具体变动的过程,是一种静止地孤立地考察某些经济现象的方法。例如研究市场均衡价格时,它研究的是价格随供求关系上下波动的趋向或者是供求决定的均衡价格,完全舍掉时间、地点等因素,并假定影响均衡价格的其他因素,如消费者偏好、收入及相关商品的价格等静止不变。



比较静态分析就是分析已知条件发生变化以后经济现象的均衡状态的相应变化,以及有关的经济变量在达到新的均衡状态时的相应变化,即对经济现象有关经济变量一次变动(而不是连续变动)的前后进行比较。例如,已知某种商品的供求状况,可以考察其供求达到均衡时的价格和产量。现在如果由于消费者的收入增加而导致对该商品的需求增加,从而产生新的均衡,使价格和产量都较以前提高。这里,只把新的均衡所达到的价格和产量与原均衡的价格和产量进行比较,这便是比较静态分析。

动态分析是对经济变动的实际过程所进行的分析,其中包括分析有关变量在一定时间过程中的变动,这些经济变量在变动过程中的相互影响和彼此制约的关系,以及它们在每一个时点上变动的速率等等。动态分析法的一个重要特点是考虑时间因素的影响,并把经济现象的变化看作一个连续的过程来看待。

进行宏观经济研究,在国民收入决定理论中,静态分析与比较静态分析运用得更多;在经济周期与经济增长理论中,则动态分析运用得更多。动态分析在宏观经济计量模型中更有大量应用。

5. 存量分析与流量分析

宏观经济学中存量和流量的区别是非常重要的,所以,对于这两种分析方法应该加以区别。所谓存量分析,主要是在分析中涉及特定时点上的经济总量,如在对经济活动进行历史性分析和比较中涉及的年度总量值、某一特定时点的货币总量等;所谓流量分析,是指经济分析中所涉及的某一时期内的经济活动的变动总量,这往往表现为以单位时间内发生的经济变动(活动)量的总值的形式,如某月份、季度的总产量、工资总量等。在宏观经济学分析中,有时会涉及流量分析,有时又会涉及存量分析,有时则会同时涉及两者。此外,在分析过程中,我们有时也会遇到存量和流量相对应的情况,这也应该加以注意。比如,投资的流量会与资本的存量相对应,储蓄的流量会与财富的存量相对应。一般说来,存量是流量的基础,而流量是存量的条件。这就好比某一时刻水库中的实际库存量是存量,而一段时间内流入的水量或者流出的水量则是流量。存量分析和流量分析的主要区别就在于所涉及的时间特性。

6. 经济模型分析方法

在宏观经济学分析中,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,只分析一些最必要的因素,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相比较都是在经济模型基础——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,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作出较准确的预测?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。但是要注意,经济学里模型很多,每一种模型说明的问题都是在假设的基础上解释经济的某一个方面。在经济学里,没有一个适用于所有目的的正确模型,在宏观经济学里,企业和家庭的行为最优化是暗含的。

第三节 宏观经济学的理论体系

简单来说,宏观经济学最终的核心问题无非是一个,即政府要不要干预经济的问题?围绕这个核心问题衍生两大理论学派,既古典经济学和凯恩斯主义经济学。但不管是哪一个学派,其最终目标都是为了实现国民收入的稳定增长,也就是既无失业、又无通货膨胀的持续增长。那么,为了实现这一目标,我们必须首先要分析哪些市场、市场中的哪些经济变量决定国民收入的大小,并由此才只能制定相应的政策来控制这些变量,使国民收入保持稳定增长,这是宏观经济学的核心内容。这个核心内容构成了宏观经济学的基本理论框架。实际上,宏观经济学的核心内容我们可以把它归结为三大模型,即 $I=S$ 模型, $IS-LM$ 模型和 $AD-AS$ 模型。我们用图 1-1 说明。

从图 1-1 可以看到,国民收入的决定在短期中和长期中是不相同的。这里短期与长期的含义与微观经济学中大致相同,即在短期中只有可变的生要素或投入(如劳动、原料等)才能发生变动,而在长期中一切生要素或投入(不但包括劳动、原料等,而且包括一个国家的机器设备、技术水平、人口数量等)都可以发生变动。

图 1-1 也表明,短期国民收入的决定取决于总需求曲线和总供给曲线。总需求曲线又取决于在三个市场中的变量情况,即产品市场、货币市场和国际市场中的变量情况。长期国民收入的决定则可以运用现代经济增长理论和经济周期理论进行分析。因此,本教材的安排如下:在第一章导论和第二章介绍国民收入的衡量之后,第三章介绍消费和储蓄理论,第四章介绍投资和货币理论,因为在现代市场经济中,国民收入的决定不但与产品市场有关,而且在很大程度上还要受到货币市场供求及利率的影响。因此,这一章引入货币市场,分析货币因素在国民收入决定过程中的作用。第五章介绍简单国民收入决定模型,从产品市场考虑,国民收入是如何达到均衡的,均衡的国民收入是如何决定的。在上述研究的基础上,从第六章将产品市场与货币市场结合起来,研究两个市场的双重均衡问题,即 $IS-IM$ 模型,也即产品市场和货币市场的一般均衡。这一模型提供了一种思考短期国民收入决定的方法,并可以运用这种模型为研究财政政策和货币政策对产出的影响提供理论依据。截至到 20 世纪 60 年代,可以说它涵盖了宏观经济理论的全貌。直到现在,它还被大多数西方学者认为是宏观经济学的最核心理论。第七章总需求—总供给模型引入前述各章所省略的价格变量,并引入了劳动力市场。一方面根据 $IS-LM$ 模型分析推导出总需求曲线,另一方面又根据劳动力市场的情况得出总供给曲线,并根据这两条曲线对国民收入在短期中的变动进行初步的解释。由于在短期,国民收入的波动往往来自于需求方面,如下所述,进行需求管理的短期宏观经济政策主要是财政政策和货币政策,因此,第八章论述宏观经济政策,并分析宏观经济政策如何进行混合使用。由于前面各章的分析都是限于封闭经济的假设进行的,即假设一国经济不与国外进行任何联系。但是,这种情况实际是不存在的,现实经济活动都离不开国际间的经济交往。因此,第九章引入国际市场,即

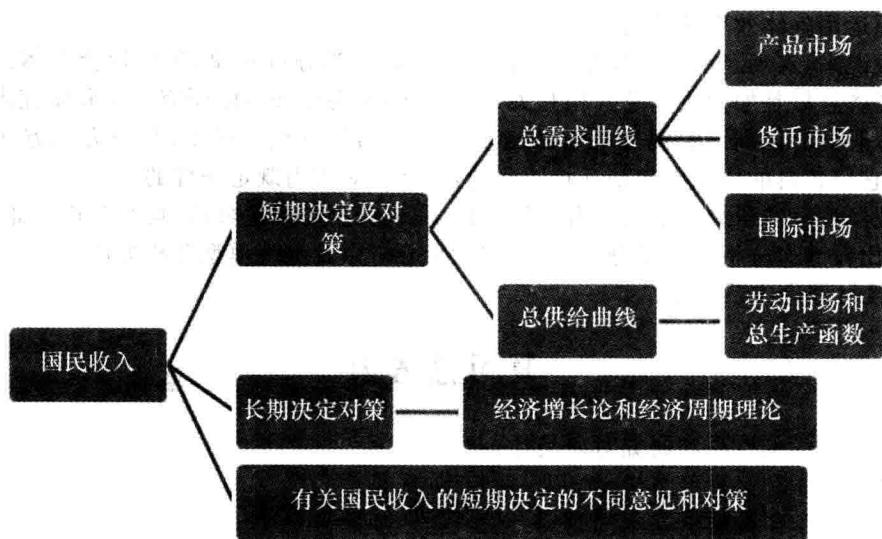


图 1-1 宏观经济学基本理论框架

开放的宏观经济模型——IS—LM—BP 模型，将国际贸易与国际资本流动纳入宏观经济分析的范畴。国际市场的引入使总需求曲线进一步复杂化。因为在宏观经济中，价格的变动牵涉劳动的供求和通货膨胀，所以，失业和通货膨胀在第十章中进行论述。失业与通货膨胀是各国经济发展中普遍存在的问题，本章主要论述失业与通货膨胀理论，这可以为政府制定相应的经济政策提供理论依据。第十一章经济周期和经济增长理论。也即是研究长期国民收入的决定即国民收入长期增长的趋势和实际国民收入围绕长期趋势而作出的周期性波动。经济增长理论和经济周期理论构成了对国民收入的变动进行长期分析的重要内容。经济增长理论主要分析经济增长的模式、经济增长的因素和经济均衡增长的条件等，经济周期理论主要分析经济波动的现象、原因和防止或减小经济周期性波动的措施。上述各章主要都是在介绍凯恩斯主义的理论，但是在目前宏观经济学领域，其实是百家争鸣。所以我们在第十二章补充介绍宏观经济学的发展展望，在介绍宏观经济学发展阶段的基础上，补充介绍其他各学派基本理论和其政策主张以及对当代宏观经济学所取得的共识，同时展望宏观经济学发展趋势并进行反思。

本书中主要留意于宏观经济学的基本概念、基本原理、基本问题和主要经济政策的选择及效应方面，又在最后一章介绍对宏观经济学的发展展望，供同学们阅读，以期对宏观经济学有一个更全面的了解。

本章小结

宏观经济学研究的核心内容是保持国民收入稳定的增长，即既无失业、又无通货膨胀的持续增长，这个核心内容构成了宏观经济学的基本理论框架，本教材章节的安排也由此进行。

本章的要点可以归结如下：

1. 从性质上说，宏观经济学是研究经济总体情况与趋势的基本理论。

2. 宏观经济学研究的对象是经济中的总量问题和总体性问题。宏观经济学的重点是围绕着短期经济波动和长期经济增长展开的。宏观经济学就是要通过对于这些问题的研究，达到提