

Macroeconomics

普通高校经济管理类**立体化**教材



免费提供教
学资源下载

基础课系列

宏观经济学

主 编 吴文盛

副主编 田 旭 徐德云 刘海军 王国贞



清华大学出版社

普通高校经济管理类立体化教材·基础课系列

宏观经济学

主 编 吴文盛

副主编 田 旭 徐德云 刘海军 王国贞

清华大学出版社

北 京

内 容 简 介

宏观经济学是经济类、管理类本科各专业必修的专业基础课,是教育部规定的经济类、管理类本科专业的核心课程之一。本书从国民收入核算入手,比较系统地介绍了封闭条件下和开放条件下的国民收入决定理论、国民经济增长、周期性波动、通货膨胀与通货紧缩、失业理论,以及宏观经济政策与主要宏观经济学流派。

本书体系结构合理、内容完整、难度适中,适合作为普通高校经济类、管理类本科生的教学用书,也适合作为其他学科大学生、研究生、各级管理干部、企业有关人员的学习参考书。

本书封面贴有清华大学出版社防伪标签,无标签者不得销售。

版权所有,侵权必究。侵权举报电话:010-62782989 13501256678 13801310933

图书在版编目(CIP)数据

宏观经济学/吴文盛主编;田旭,徐德云,刘海军,王国贞副主编.—北京:清华大学出版社,2007.9
(普通高校经济管理类立体化教材·基础课系列)

ISBN 978-7-302-15886-8

I. 宏… II. ①吴… ②田… ③徐… ④刘… ⑤王… 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(2007)第 123163 号

责任编辑:李春明 宣 颖

封面设计:杨玉兰

版式设计:北京东方人华科技有限公司

责任校对:李玉萍

责任印制:孟凡玉

出版发行:清华大学出版社 地 址:北京清华大学学研大厦 A 座

<http://www.tup.com.cn> 邮 编:100084

c-service@tup.tsinghua.edu.cn

社 总 机:010-62770175 邮购热线:010-62786544

投稿咨询:010-62772015 客户服务:010-62776969

印 刷 者:清华大学印刷厂

装 订 者:北京市密云县京文制本装订厂

经 销:全国新华书店

开 本:185×260 印张:21.25 字数:512 千字

版 次:2007 年 9 月第 1 版 印 次:2007 年 9 月第 1 次印刷

印 数:1~4000

定 价:29.00 元

本书如存在文字不清、漏印、缺页、倒页、脱页等印装质量问题,请与清华大学出版社出版部联系调换。联系电话:(010)62770177 转 3103 产品编号:026294-01



前 言

宏观经济学是经济类、管理类本科各专业必修的专业基础课,是教育部规定的经济类、管理类本科各专业的核心课程之一,一般安排在大学一年级下学期或大学二年级上学期讲授,安排学时多为 48~60 学时,即 3 学分。本书是针对大部分高校宏观经济学这一课程的设置特点和课程性质而编写。

宏观经济学是采用总量分析的方法研究国民经济总体的运行及其规律的科学。它从国民收入核算入手,介绍封闭条件下和开放条件下的国民收入决定理论,探讨国民经济增长、周期性波动、通货膨胀与通货紧缩、失业等问题,从理论上阐明了宏观经济政策的来源及其效果与不足,为国民经济的持续、稳定增长,提供政策依据。鉴于此,本书的结构安排遵循基础理论——国民收入决定——宏观经济问题——宏观经济政策的顺序。具体安排上,宏观经济学基础理论包括第一章导论、第二章国民收入核算、第三章消费与储蓄理论、第四章投资与货币理论。国民收入决定理论包括第五章简单国民收入决定模型、第六章扩展的凯恩斯宏观经济模型:IS-LM 模型、第七章国民收入决定的 AD-AS 模型和第十三章开放的宏观经济模型:IS-LM-BP 模型。这四章内容分别介绍一个市场(产品市场)均衡、两个市场(产品市场和货币市场)均衡、三个市场(产品市场、货币市场和劳动市场)均衡和四个市场(产品市场、货币市场和劳动市场和国外市场)均衡,其中,由于四个市场均衡属于开放经济条件下,因此放在第十三章。宏观经济问题包括第八章失业理论、第九章通货膨胀与通货紧缩理论、第十章经济周期理论、第十一章经济增长理论,分别研究失业、通货膨胀与通货紧缩、经济周期、经济增长四个宏观经济问题。宏观经济政策部分包括第十二章宏观经济政策和第十四章宏观经济学流派。各流派对宏观经济政策都提出了各自的主张,因此归入本书的第四部分。但宏观经济学流派在内容上相对独立,因此作为第十四章。

本教材的主要特点如下。

(1) 主要介绍凯恩斯主义宏观经济学,也适当介绍非凯恩斯主义宏观经济学。这是因为,凯恩斯主义宏观经济学仍然对世界各国经济与政策产生重要而深远的影响。同时,本书还注重吸收宏观经济学最新的研究成果,比如,增加了新凯恩斯主义经济学、实际经济周期理论、通货紧缩理论、工资粘性与价格粘性理论、菜单成本等。

(2) 更贴近教师和学生,更有利于教与学的有机结合。教材是教与学联系的桥梁。一本好的教材,既能方便教师讲授,又有利于学生理解和掌握教学的基本内容。本书的编写人员均为讲课经验丰富、多年从事宏观经济学或西方经济学教学的高校骨干教师,他们非常清楚授课内容的难点、重点与取舍,了解哪些方面易于学生理解,因此,在本书编写过程中,舍弃了难度较大、不属于本科层次需要掌握的内容,适当增加知识拓展内容,如书中增加了“专栏”、作为立体教材一部分的“知识拓展”(放在网上),以便教师备课和感兴趣的学生拓展视野。

(3) 吸收国内外同类教材的优点,在结构、层次上更合理。与国内同类教材相比,本

教材摒弃内容重复、逻辑关系混乱和语言生涩的缺点，在结构、层次上更合理，在逻辑关系上更清楚；与国外同类教材相比，在概念的定义上更清楚，内容上更简洁，语言表达上更易于中国学生理解和接受。

(4) 注重与中国实际结合。学习宏观经济学，目的是为了解决中国经济的实际问题。因此，本书在写作过程中，在注重介绍宏观经济学基本理论的前提下，专栏内容及案例分析基本采用中国的素材，这样更有易于学生的理解。

本书是多所大学的教师共同合作的成果。石家庄经济学院的吴文盛编写第一、三、四章，河南理工大学的刘海军编写第二、七、八章，河北科技大学的王国贞编写第五、六章，青岛大学的田旭编写第九、十二章，石家庄经济学院的徐德云编写第十、十一、十三章，石家庄经济学院的连季婷编写第十四章。课件制作由各章编写教师完成。另外，石家庄经济学院的牛晓耕、吴文盛编写了知识拓展、“教学大纲”。全书的写作提纲、统稿及教学辅助材料的审定工作由吴文盛完成。

本书在写作过程中，参考了许多专著和教材，书后的参考文献列出了相关书目，在此对其作者表示衷心的感谢！

当然，由于写作的时间比较短，加上作者水平有限，书中疏漏在所难免，恳请读者批评指正，以便再版时予以改正。

编 者
2007年6月



目 录

第一章 导论..... 1	二、三部门经济中的投资-储蓄恒等式..... 28
第一节 宏观经济学的含义与特点..... 1	三、四部门经济中的投资-储蓄恒等式..... 29
一、宏观经济学的含义..... 1	第四节 名义 GDP 与实际 GDP..... 30
二、宏观经济学的特点..... 2	一、名义 GDP 和实际 GDP..... 30
第二节 宏观经济学的产生与发展..... 3	二、GDP 紧缩指数..... 31
一、宏观经济学的萌芽..... 4	本章小结..... 32
二、现代宏观经济学的建立..... 5	复习思考题..... 32
三、宏观经济学的发展..... 6	第三章 消费与储蓄理论..... 34
第三节 宏观经济学的研究对象与研究方法..... 8	第一节 消费与消费函数..... 35
一、宏观经济学的研究对象..... 8	一、消费的含义..... 35
二、宏观经济学的研究方法..... 10	二、消费支出及其影响因素..... 35
本章小结..... 11	三、消费函数..... 38
复习思考题..... 12	第二节 储蓄与储蓄函数..... 43
第二章 国民收入核算..... 13	一、储蓄的含义..... 43
第一节 国民收入的核算指标..... 14	二、储蓄函数..... 44
一、国内生产总值..... 14	三、消费与储蓄的关系..... 46
二、国民生产总值..... 16	第三节 消费理论的发展..... 48
三、国内生产净值..... 16	一、相对收入假说..... 48
四、国民收入..... 17	二、持久收入假说..... 50
五、个人收入..... 17	三、生命周期假说..... 52
六、个人可支配收入..... 17	本章小结..... 54
第二节 国民收入的核算方法..... 19	复习思考题..... 55
一、总产出、总收入与总支出..... 19	第四章 投资与货币理论..... 57
二、生产法..... 20	第一节 投资理论..... 58
三、收入法..... 20	一、投资的决定因素..... 58
四、支出法..... 21	二、投资函数..... 59
五、国民收入核算的缺陷与纠正..... 23	三、资本边际效率..... 60
第三节 国民收入核算中的恒等关系..... 26	四、投资需求曲线的移动..... 63
一、两部门经济中的投资-储蓄恒等式..... 26	第二节 货币供给理论..... 64
	一、货币的定义及其计量..... 64



二、货币的供给	68	三、IS-LM 模型的政策含义	124
第三节 货币需求理论	72	本章小结	126
一、传统的货币需求理论	72	复习思考题	127
二、货币需求	74	第七章 国民收入决定的 AD-AS 模型	130
三、利率由货币供求决定	80	第一节 AD 曲线	130
本章小结	81	一、AD 曲线的推导	130
复习思考题	82	二、总需求曲线的特征	133
第五章 简单国民收入决定模型	84	第二节 AS 曲线	135
第一节 两部门经济的国民收入决定	85	一、宏观生产函数	135
一、两部门经济的收入支出	85	二、劳动市场均衡	136
二、投资储蓄分析	87	三、AS 曲线的推导	138
三、乘数原理	88	第三节 AD-AS 均衡	142
第二节 三部门经济的国民收入决定	90	一、AD-AS 模型	142
一、三部门经济的国民收入	90	二、AS 曲线的移动	143
二、三部门经济中的乘数	94	三、AD 曲线的移动	144
第三节 四部门经济的国民收入决定	98	四、非充分就业均衡	145
一、四部门经济的国民收入	98	五、总供求模型的政策含义	150
二、四部门经济中的乘数	100	本章小结	153
本章小结	101	复习思考题	154
复习思考题	101	第八章 失业理论	155
第六章 扩展的凯恩斯宏观经济模型:		第一节 失业概述	156
IS-LM 模型	104	一、失业界定	156
第一节 产品市场均衡与 IS 曲线	105	二、失业的分类	158
一、IS 曲线的推导	105	三、失业的影响与奥肯定律	161
二、IS 曲线的斜率	108	第二节 失业的形成机理	164
三、IS 曲线的移动	109	一、自愿失业论	164
四、产品市场的失衡	111	二、有效需求不足失业论	164
第二节 货币市场的均衡与 LM 曲线	112	三、自然失业率论	165
一、LM 曲线及其推导	112	四、技术进步失业论	166
二、LM 曲线的斜率	114	五、货币失业论	167
三、LM 曲线的移动	116	第三节 失业的治理	169
四、货币市场的失衡	117	一、摩擦性失业的治理	169
第三节 IS-LM 模型分析	118	二、周期性失业的治理	169
一、产品市场和货币市场的同时均衡:		三、结构性失业的治理	169
IS-LM 模型	118	四、建立完善的失业保障体系	170
二、均衡国民收入与均衡利率的		本章小结	171
变动	122	复习思考题	171

第九章 通货膨胀与通货紧缩理论	173
第一节 通货膨胀	174
一、通货膨胀概述	174
二、通货膨胀产生的原因	179
三、通货膨胀的影响	181
四、通货膨胀的治理	184
五、菲利普斯曲线	185
第二节 通货紧缩	189
一、通货紧缩概述	189
二、通货紧缩产生的原因	192
三、通货紧缩的治理	195
本章小结	200
复习思考题	200
第十章 经济周期理论	202
第一节 经济周期及其类型	202
一、经济周期的含义	203
二、经济周期的类型	204
第二节 主要经济周期理论	205
一、熊彼特创新周期理论	205
二、乘数-加速数模型	207
三、货币主义的经济周期理论	210
四、理性预期学派的经济周期理论	211
五、实际经济周期模型	213
本章小结	217
复习思考题	218
第十一章 经济增长理论	219
第一节 经济增长的含义与源泉	220
一、经济增长的含义与特征	220
二、经济增长的源泉	221
三、经济增长与经济发展	222
第二节 经济增长因素的分析	223
一、肯德里克的全要素生产率分析	223
二、丹尼森对经济增长因素的分析	224

三、库兹涅茨对经济增长因素的分析	224
第三节 主要经济增长模型介绍	226
一、哈罗德-多马经济增长模型	226
二、新古典增长模型	228
三、新剑桥经济增长模型	234
四、新经济增长理论	237
本章小结	239
复习思考题	240
第十二章 宏观经济政策	241
第一节 宏观经济政策概述	242
一、宏观经济政策的形成与发展	242
二、宏观经济政策目标	245
第二节 财政政策与货币政策	247
一、财政政策	247
二、货币政策	251
第三节 财政政策与货币政策效应	256
一、财政政策效应	256
二、货币政策效应	259
三、财政政策与货币政策配合使用	260
四、政府失灵(含财政政策与货币政策的局限性)	262
第四节 其他宏观经济政策	266
一、收入政策	266
二、人力政策	267
三、技术进步政策	268
四、鼓励资本形成政策	269
五、对外贸易政策	269
本章小结	272
复习思考题	273
第十三章 开放的宏观经济模型: IS-LM-BP 模型	274
第一节 汇率理论	274
一、外汇与汇率	274
二、汇率的决定	276
三、影响汇率变动的其他因素	277



四、汇率变动对经济的影响.....	278	四、货币学派的政策主张.....	308
五、汇率制度	280	第二节 理性预期学派.....	310
第二节 国际收支与国际收支平衡表.....	281	一、理性预期学派的产生.....	311
一、特定账户分类	282	二、理性预期学派的两个假说.....	311
二、国际收支平衡及其曲线.....	284	三、理性预期学派的主要观点.....	312
三、国际收支失衡原因及其影响.....	288	四、理性预期学派的政策主张.....	316
四、调整国际收支失衡的政策.....	289	第三节 供给学派.....	317
第三节 IS-LM-BP 模型及其应用.....	291	一、供给学派的产生.....	317
一、IS-LM-BP 模型	291	二、供给学派的基本理论和 政策主张.....	318
二、IS-LM-BP 模型的应用： 财政政策与货币政策效应.....	293	三、供给学派的理论实践及其 后果.....	321
三、调整国内均衡与国外均衡的 政策	298	第四节 新凯恩斯主义.....	321
本章小结	301	一、新凯恩斯主义的产生.....	322
复习思考题	301	二、新凯恩斯主义的基本假设.....	322
第十四章 宏观经济学流派	302	三、新凯恩斯主义的 主要经济理论.....	323
第一节 货币学派	303	四、新凯恩斯主义的政策主张.....	325
一、货币学派的产生.....	303	本章小结	326
二、货币学派的理论渊源.....	303	复习思考题.....	327
三、货币学派的基本理论.....	305		



第一章 导 论

本章导读

也许我们很熟悉身边的事物——汽车、房屋、树木等，因为，这些事物都可以近距离观测到，但是，当你看到从数千公里外的卫星上拍摄的地球照片时，你所熟悉的身边的事物不见了，取而代之的是你不熟悉的大画面：辽阔的海洋像水坑，大陆像肮脏的土墩，山脉像床单的褶皱……

微观经济学是用“显微镜”从近距离局部的角度来看问题，所观察到的是单个个体和单个市场的具体行为，而宏观经济学则是用“望远镜”从远距离全局的角度来看问题，较小事物在宏观经济学的视野里消失了，取而代之的是许多个体单位和市场总体的轮廓、总体的特征。从本章开始，我们将带领大家学会用“望远镜”来观察问题，研究整个国民经济的总体特征与规律，并为国民经济的健康发展提出政策建议。

学习目标

通过对本章的学习，理解宏观经济学的含义与特点，了解宏观经济学的产生和发展、宏观经济学的研究对象和研究方法、宏观经济学的基本内容。

关键概念

宏观经济学(Macroeconomics)

凯恩斯革命(Keynes Revolution)

总量分析(Aggregate Analysis)

第一节 宏观经济学的含义与特点

一、宏观经济学的含义

第二次世界大战以后，西方经济学家逐渐把经济学划分为宏观经济学(Macroeconomics)和微观经济学(Microeconomics)。从字面上看，Macroeconomics 由 Macro 和 economics 两个词组成，Macro 来源于希腊文 Μακρο，原意是“大”、“宏大”之意，与 Micro(有“微小”之意)相对应；economics 的意思是“经济学”。因此，Macroeconomics 被译为“宏观经济学”，而 Microeconomics 被译为“微观经济学”。从学科归属上，宏观经济学属于理论经济学。

“宏观经济学”这一概念是挪威经济学家、奥斯陆大学教授拉格纳尔·弗瑞希(Ragnar Frisch)于 1933 年首次提出的。此后，许多学者对宏观经济学给出定义，但基本含义大致相同，比较典型的有以下几种。



保罗·萨缪尔森(Paul A. Samuelson)和威廉·诺德豪斯(William D. Nordhaus)在《经济学》(第16版)中指出:“宏观经济学是将整个经济运行作为一个整体来进行研究的,考察的是整个国家的产出、就业和价格。”

R.多恩布什(R. Dornbusch)和S.费希尔(S. Fischer)在其《宏观经济学》中指出:“宏观经济学是研究整体经济行为的高涨与衰落、经济中产品与劳务总量的增长、通货膨胀与失业率、国际收支以及汇率。为了研究经济的一般状况,宏观经济学研究集中在影响经济状况的经济行为与政策上——消费与投资、工资与价格变动的决定因素、货币与财政政策、货币存量、联邦预算、利率、公债。”

因此,宏观经济学可以定义为:采用总量分析方法,研究国民经济总体的运行及其规律的学科。之所以这样定义,是因为:第一,突出宏观经济学的研究方法——总量分析法;第二,突出宏观经济学的研究对象——国民经济总体;第三,表现出社会科学的一般特征,宏观经济学作为一门社会科学,研究国民经济总体的运行及其规律。

二、宏观经济学的特点

与微观经济学相比,宏观经济学有以下几个显著特点。

1. 以国民经济整体为研究对象

微观经济学是以单个经济主体(个人、企业及市场)为研究对象,研究其经济行为及其后果,而宏观经济学是研究国民经济的总体行为、考察经济的总体趋势,通过研究经济总量的决定及其变化,来说明社会资源的充分利用问题。也就是说,宏观经济学所研究的不是经济中的个体单位,而是由这些单位组成的总体;不是研究“树木”,而是研究由这些“树木”组成的“森林”的整体行为。

2. 采取总量分析方法

微观经济学采用个量分析方法,研究经济变量单个数值的决定,而宏观经济学则是采用总量分析方法,对能够反映整个经济状况的经济变量及模型进行分析,在总体上研究国民经济的运行方式与规律。总量是反映国民经济整体运行状况的变量,可分为两类:一是个量的总和,如国民收入、总投资、总消费等;二是平均量,如物价水平、增长率、利率、汇率等。但由于个量之间相互联系、相互影响,因此,不能简单理解为总量就是个量的简单相加。而总量分析则是分析这些总量(国民收入、就业水平、价格水平、经济增长率和国际收支状况)的决定、变动及其相互关系,揭示经济整体的运行状况及其规律,提出应该采取的对策措施。

3. 以市场机制有缺陷、政府可以弥补其不足为前提条件

微观经济学的假设前提是市场出清、完全理性和完全信息,认为市场这只“看不见的手”能够自我调节以实现资源的最优配置。而宏观经济学则假设市场这只“看不见的手”有缺陷,但政府有能力运用这只“看得见的手”来弥补市场机制的不足。

4. 要解决的是资源的利用问题

微观经济学要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。厂商从要素市场上获得生产要素,生产出消费者需要的产品,由此,厂商实现利润最大化,消费者实现效用最大化。而宏观经济学则围绕国民收入决定这个核心,研究现有资源未充分利用的原因和实现充分利用的途径,以及如何实现经济的长期增长等问题,从而实现社会福利的最大化。

5. 中心内容是国民收入决定理论

微观经济学的中心内容是价格决定理论,包括消费者行为理论、生产理论、成本理论、分配理论、一般均衡理论和市场理论;而宏观经济学的中心内容是国民收入决定理论,包括通货膨胀与通货紧缩理论、就业理论、经济周期理论、经济增长理论和宏观经济政策等。

当然,宏观经济学与微观经济学并不是决然分开的,而是相互联系的。首先,宏观经济学和微观经济学是经济学两个不可或缺的组成部分,两者互相补充。没有宏观经济学或者微观经济学,经济学都是不完整的。从宏观经济学与微观经济学的研究对象与研究方法来看,宏观经济学是以国民经济整体为研究对象,采用的是总量分析方法,而微观经济学是以个体经济单位为研究对象,采用的是个量分析方法,因此,宏观经济学与微观经济学是整体与个体的关系。其次,微观经济学是宏观经济学的基础。由于一个国家的国民经济,归根到底是由消费者、劳动者、厂商以及市场等无数个个体经济单位组成的,对国民经济整体的分析离不开微观的个体,而对微观经济主体的分析是微观经济学的内容,因此,微观经济学是宏观经济学的基础,宏观经济学是微观经济学的引申与拓展。比如,对国民经济总消费的分析时,可以从家庭的消费函数入手;对总供给的分析,可以从劳动市场均衡入手。

第二节 宏观经济学的产生与发展

和其他任何一门学科一样,宏观经济学也经历了萌芽、产生与发展演变的历程。我们可以把宏观经济学的产生与发展历程大致分为三个阶段:第一阶段,宏观经济学的萌芽。从17世纪中叶到1936年约翰·梅纳德·凯恩斯(John Maynard Keynes)的《就业、利息和货币通论》(以下简称《通论》)发表以前这段时间,是宏观经济学的萌芽时期。这一时期没有宏观经济学的概念,但出现了对国民经济整体进行研究的宏观经济分析及宏观经济政策,而且,宏观经济理论与微观经济理论没有严格区分开。第二阶段,现代宏观经济学建立。从凯恩斯的《通论》发表以后到20世纪70年代这段时间,是现代宏观经济学的产生与完善时期,其主要特点是形成了完善的宏观经济体系。第三阶段,宏观经济学的发展。从70年代到现在是新宏观经济学的形成与发展时期。70年代,凯恩斯理论无法解释经济“滞胀”现象,出现了以新自由主义为代表的宏观经济理论。

一、宏观经济学的萌芽

在古典经济学中,尽管没有宏观经济学这个概念,也没有形成宏观经济理论体系,但是,许多经济学家对宏观经济问题进行分析,并做出了重要的贡献。

古典经济学创始人威廉·配第(William Petty)在 1662 年出版的《赋税论》中研究了税收对一个国家的重要作用,并提出了一系列改进税制、增加税收和促进贸易的主张;他在 1690 年出版的《政治算术》中对一个国家国民财富的构成及其增长的原因进行分析;他在 1691 年《献给英明人士》中首次对英国当时的总产出和国民收入进行估算。

重农主义学派代表弗朗索瓦·魁奈(F. Quesnay)在 1758 年出版的《经济表》中从宏观的角度对社会总产品和流通过程进行分析。魁奈的最大贡献是第一次从社会总产品的角度提出了保持生产的协调对经济增长的重要作用。

古典经济学的杰出代表亚当·斯密(Adam Smith)在 1776 年出版的《国民财富的性质和原因的研究》(以下简称《国富论》)中不仅提出了国民财富的概念,而且还分析了社会总资本的再生产以及增加国民财富的方法,并提出了自由放任的政策主张。他的国际分工理论是当代国际贸易理论的学术渊源之一。

古典经济学的完成者大卫·李嘉图(David Ricardo)在 1817 年出版的《政治经济学及赋税原理》中研究了资本主义社会中社会产品在地主、资本家和工人之间进行分配的规律,讨论了资本积累与再生产,并提出了按比较成本原则进行国际贸易的理论。

此外,还有让·巴蒂斯特·萨伊(Jean Baptiste Say)在 1803 年出版的《政治经济学概论》中提出的“供给创造需求”定律,西斯蒙第(J. C. Simondi)在 1919 年出版的《政治经济学新原理》,马尔萨斯(T. R. Malthus)在 1798 年出版的《人口原理》和 1827 年出版的《政治经济学定义》中提出的经济危机理论等,都是对宏观经济问题进行研究而取得的重要成果。

“边际革命”出现以后,马歇尔将古典经济学和边际效用理论结合起来,建立了微观经济体系,西方经济学也进入了新古典经济学阶段。尽管经济危机(周期性波动)和失业问题很严重,但新古典经济学并没有把宏观经济问题作为研究的中心,而是把充分就业当作前提,着力于研究资源的优化配置问题,因而,微观经济学得到长足发展。

进入 20 世纪以后,经济危机日益恶化,经济学家们又开始重视宏观经济问题的研究,并取得了一些重大成果。不过,宏观经济理论没有形成体系。这一时期的宏观经济理论比较典型的有:瑞典经济学家克努特·威克塞尔(K. Wicksell)在 1898 年出版的《利息与价格》和 1906 年出版的《国民经济学讲义》中提出了一般价格水平的决定与积累过程理论;瑞典经济学家冈纳·缪尔达尔(G. Myrdal)和罗伯特·林达尔(R. Lindahl)等人提出的动态均衡理论;奥地利经济学家冯·哈耶克(F. Hayek)的经济周期理论和自由主义思想;美国经济学家约瑟夫·熊彼特(J. Schumpeter)的创新理论和周期理论;英国经济学家庇古(A. Pigou)和美国经济学家费雪等人提出的货币数量学说;美国经济学家米切尔(W. Mitchel)等人提出的统计指标与核算理论。

这些经济学家的宏观经济理论为宏观经济学的创立奠定了基础。

二、现代宏观经济学的建立

1929—1933年西方资本主义世界爆发了严重的经济危机。这次危机持续时间之长，工业生产下降幅度之大，失业人数之多，波及范围之广，是资本主义历史上空前的。然而占统治地位的新古典经济学却无能为力。为了摆脱经济危机的影响，急需新的理论作指导。凯恩斯的宏观经济学正是在这种背景下为挽救资本主义制度而诞生的。

凯恩斯的宏观经济理论是对传统经济学的彻底否定，被称为“凯恩斯革命”。凯恩斯1936年出版的《通论》被认为是现代宏观经济学诞生的标志，凯恩斯本人也被认为是宏观经济学之父。“凯恩斯革命”主要体现在以下几个方面。

1. 经济理论上的“革命”

传统经济学信奉“萨伊定律”，认为供给能够自动创造需求，经济体系能够通过市场机制的作用自动地实现均衡，因而，否认生产过剩危机的普遍存在；传统经济学认为储蓄永远等于投资，即储蓄能够通过银行的作用，在利率机制的作用下，全部转化为投资，实现储蓄与投资的均衡；传统经济学认为通过市场机制的调节，资源能够得到充分的利用，社会不会存在失业，如果有失业，也只是“摩擦失业”或“自愿失业”，而不存在非自愿失业。

但是，凯恩斯否定萨伊定律，提出了著名的“有效需求创造供给”的“凯恩斯定律”。他否定投资永远等于储蓄，否认传统的失业理论，而承认非自愿失业的存在。他认为，供给和需求并不必然相等，如果收入不是全部用于支出，供给并不等于需求；储蓄与投资来源于不同的主体，储蓄与投资的动机并不相同，又由于影响储蓄的主要因素是收入，影响投资的主要因素是预期利润率与市场利率的差额，因此，单靠市场利率的调节很难实现储蓄与投资的均衡。由于有效需求不足导致非自愿失业的存在，因此，充分就业并不是常态。他认为，有效需求不足是边际消费倾向递减、资本边际效率递减和流动性陷阱综合作用的结果，而市场机制本身没有力量使总需求与总供给在充分就业水平上达到均衡，这必然会导致低水平的非充分就业的均衡。现实资本主义生产过剩的经济危机是由于有效需求不足造成的，因此，要避免经济衰退和失业，必须依靠政府的力量对经济进行干预，在衰退和萧条时期，通过增加政府购买和政府投资来增加有效需求，使之达到充分就业的均衡，这样，资本主义经济危机就可以得到解决。

2. 经济政策上的“革命”

在经济政策上，凯恩斯强调政府干预经济的必要性，否认传统的、自由放任的经济政策。凯恩斯认为，市场机制的作用是有缺陷的，它难以使经济达到充分就业的均衡，因此，必须扩大政府的作用，通过加强政府的干预来使经济实现充分就业水平上的均衡发展。在具体的政策设计上，他坚持以需求管理为中心，主张把财政政策放在首位，而把原来居于主导地位的货币政策放在辅助地位，提出了膨胀性的财政政策和“半通货膨胀”的价格一般理论，反对传统的健全财政原则和稳定物价的政策。



3. 分析方法上的“革命”

在分析方法上,凯恩斯在《通论》中采用了完全不用于微观经济学的总量分析方法,把整个国民经济的运行状态作为研究对象,研究总需求与总供给的均衡、总就业量、总产出、国民收入总量及其波动的原因,这不能不说是经济学分析方法上的一次革命。

总之,“凯恩斯革命”的核心是强调政府对经济的干预。“凯恩斯革命”也促使资本主义经济发展史上的“第二个黄金时期”(第二次世界大战以后)的出现。

凯恩斯的《通论》出版以后,许多追随者做了大量的研究工作,补充和发展了凯恩斯的宏观经济理论,建立起比较完善的现代宏观经济学理论体系与框架。这方面的贡献主要如下。

(1) IS-LM 模型。IS-LM 模型是由英国经济学家希克斯(J. Hicks)在 1937 年建立起来的,后又经美国经济学家汉森(A. Hansen)加以补充完善。IS-LM 模型从理论上概括了凯恩斯的有效需求决定理论,揭示了商品市场和货币市场均衡时总产出与利率的决定机制。该模型还可以分析财政政策与货币政策对宏观经济的影响,从而为凯恩斯的政府干预经济的政策主张提供依据。这一模型被认为是凯恩斯主义宏观经济理论的核心。

(2) 哈罗德-多马模型。美国经济学家罗伊·福布斯·哈罗德(R. F. Harrod)和爱弗赛·多马(E. D. Domar)分别于 1939 年和 1946 年根据凯恩斯的理论建立起来的结论相似的经济增长模型,被称为哈罗德-多马模型。该模型克服了凯恩斯模型侧重于短期和静态分析的不足,使凯恩斯宏观经济理论长期化与动态化。

(3) 乘数-加速数模型。美国经济学家汉森和萨缪尔森于 1939 年发展了凯恩斯投资理论,建立起乘数-加速数模型。该模型克服了凯恩斯投资乘数理论的片面性,用投资、收入和消费三个变量来分析经济周期性波动的原因。

(4) 开放条件下的宏观经济模型。奥地利经济学家弗里兹·马克卢普(F. Machlup)于 1943 年出版的《国际贸易和国民收入乘数》一书中把凯恩斯的乘数理论应用到国际经济与国际贸易理论中,建立起开放经济条件下的宏观经济模型。这一模型弥补了凯恩斯宏观经济模型使用于封闭经济体系的不足。

三、宏观经济学的发展

政府干预经济并不是解决所有经济问题的灵丹妙药。20 世纪 60 年代末西方国家出现的经济“滞胀”现象使凯恩斯的宏观经济学无能为力。所谓的“滞胀”是指经济萧条(失业)与通货膨胀并存的经济现象。按照凯恩斯的宏观经济理论,失业和通货膨胀是可以相互替代的,高失业率和高通货膨胀率是不可能同时并存的。然而,凯恩斯的宏观经济理论不能解释经济“滞胀”的原因,也无法为“滞胀”开出医治的良方。

凯恩斯的宏观经济理论面临的危机为新的宏观经济理论的产生提供了契机。20 世纪 70 年代以来,宏观经济学学派林立,新凯恩斯主义学派、新自由主义思潮复兴,现代货币主义学派、理性预期学派、供给学派、新制度经济学产生并得到发展。尽管这些学派从不同的角度进行分析,提出了各自的政策主张,各学派之间存在严重的分歧与对立,但有一个共同的特点:都是强调“看不见的手”的作用,主张减少政府对宏观经济的干预。

宏观经济学发展的另一个特点是逐步建立起有微观基础的宏观经济学。英国经济学家

约翰·希克斯从利率决定理论、IS-LM 分析、预期理论、刚性工资理论等方面论述了凯恩斯理论是微观经济学的一个特例，开创了宏观经济学微观化的先河。新凯恩斯主义者针对凯恩斯主义宏观经济学缺少价格和工资粘性的微观基础问题，从区分名义粘性和实际粘性开始，进而解释粘性的产生原因及其宏观经济意义，提出了有微观基础的政策主张。理性预期学派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，把分析重点放在具有理性预期的公众的行为上，研究这些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。在总量的分析上，理性预期学派从分析微观经济行为和经济变量中归纳和概括出宏观经济行为和宏观经济变量的关系，建立起宏观分析和微观分析的内在逻辑，并建立起一个统一的经济学体系。此外，还有一些经济学家将微观经济学的研究成果，如新制度经济学的交易费用理论、产权理论等，应用到宏观经济分析中，并取得了可喜的成就。

【专栏 1-1】宏观经济学在中国的发展

解放以后，中国经济的发展经历了计划经济体制、计划经济体制向市场经济转变和社会主义市场经济三个阶段。与此相适应，宏观经济学在中国的发展也经历了马克思主义宏观经济理论的继承与发展、马克思主义宏观经济理论向宏观经济学范式转变和宏观经济学“本土化”三个发展阶段。

第一阶段，马克思主义宏观经济理论的继承与发展。这一阶段是从 20 世纪 50 年代到 80 年代初，研究的中心问题是马克思社会再生产理论及其应用。20 世纪 50 年代，在完成经济恢复任务以后，我国开始了社会主义工业化的历程。50 年代，我国经济理论界论证了优先发展重工业的方针符合马克思关于扩大再生产两大部类的关系和列宁关于生产资料优先增长的原理。与此同时，我国讨论了如何使工业和农业、重工业与轻工业、基本建设和人民生活保持一定比例的发展问题，提出了综合平衡、保持经济协调发展的经验标准和数量界限。毛泽东 1956 年的《论十大关系》集中反映了这一时期的研究成果。20 世纪 60 年代，我国老一代经济学家于光远、孙冶方、薛暮桥等组织和发起了再生产、经济核算和经济效果三大问题的讨论，并取得了颇有建树的理论成果。刘国光和董辅初于 80 年代出版的《社会主义再生产问题》和《社会主义再生产和国民收入问题》反映了当时的研究成果。十一届三中全会以后，我国的工作重心转移到经济建设上来，理论界研究和讨论的中心议题仍然是再生产理论，并且出版了《学习马克思的再生产理论》、《马克思的再生产理论》、《两大部类对比关系研究》和《社会主义再生产有关再生产范畴的分析》等著作。

第二阶段，马克思主义宏观经济理论向宏观经济学范式转变。这一阶段是从 20 世纪 80 年代初到十四大之前。党的十二届三中全会通过的《中共中央关于经济体制改革的决定》确定了社会主义经济是以公有制为基础的有计划的商品经济，我国开始了市场取向的改革之路，理论界积极引进现代经济学。一些中青年经济学家转向宏观经济理论与方法的研究，并取得了许多重要的研究成果。代表性的有戴园晨的《社会主义宏观经济学》(1986 年)，符钢战、史正富、金重仁的《社会主义宏观经济分析》(1986 年)和樊纲、张曙光的《公有制宏观经济理论大纲》(1990 年)。这一阶段，理论研究开始从生产领域转向整个国民经济的研究，并且采用了现代宏观经济学的研究方法，研究的内容涉及宏观经济学



的各个方面。

第三阶段,宏观经济学“本土化”。十四大提出《中共中央关于建立社会主义市场经济体制若干问题的决定》,我国经济开始进入社会主义市场经济的轨道。与此同时,中国的宏观经济理论研究经历了 20 世纪 80 年代的引进、消化与吸收以后,也进入了“本土化”的阶段,即根据中国经济的现实特点,采用现代宏观经济学分析方法,提出了中国特色的宏观经济理论,从而建立起中国版的宏观经济学。这一阶段涌现出了许多创新性的研究成果,代表性的有:吴敬琏的《中国经济改革的整体设计》(1990 年)和《当代中国经济改革:战略与实施》(1999 年)、于光远的《社会主义市场经济的理论与实践》(1992 年)、胡汝银的《低效率经济学:集权体制理论的重新思考》(1992 年)、张曙光《中国宏观经济理论》、《论争与发展:中国经济理论 50 年》(张卓元主编,1999 年)、樊纲的《体制改革与宏观稳定——中国体制转轨新时期的宏观经济问题研究》(1997 年);厉以宁的《非均衡的中国经济》(1992 年)、贝纳西的《市场非均衡经济学》(1989 年)与《宏观经济学:非瓦尔拉斯分析方法导论》(1990 年)、吴晓求的《紧运行论——中国经济运行的实证性考察》(1991 年)、《社会主义经济运行分析——从供求角度所作的考察》(1992 年)、杨瑞龙的《宏观非均衡的微观基础》(1992 年);李拉亚的《通货膨胀机理与预期》(1991 年)、陈学彬的《宏观金融博弈分析》(1998 年);陈东琪的《强波经济论》(1992 年)、《微调论——走出短缺后的中国经济与政策》(1999 年);郑超愚的《中国宏观经济分析的理论框架》(1998 年)、李晓西的《宏观经济学(中国版)》(2005 年),此外还有大量的富有创新性的学术论文。其中,吴敬琏、胡汝银、张曙光、樊纲等从中国经济实践出发确立了宏观经济学的研究对象与分析角度;厉以宁、贝纳西、吴晓求、杨瑞龙等引入非均衡概念,并致力于将宏观经济结论置于合理的微观分析基础之上;樊纲、张曙光、王利民等引入了制度分析;李拉亚、宋国青、薛万祥、陈学彬等引入预期与博弈分析;陈东琪等系统化了在 80 年代末与 90 年代初形成的微调理论;郑超愚、李晓西尝试构造一个一致的宏观经济分析理论框架。

可以说,经过大批经济学家的不懈努力,初步形成了中国特色的宏观经济理论体系或称其为中国版的宏观经济学,为宏观经济调控建立了理论基础。不过,距离成熟的中国版宏观经济学还有很长的路要走。

(资料来源:陈东琪,张亚斌.中国宏观经济学的理论构架与创新发展[J].社会科学战线,2002.6;

张曙光.宏观经济理论研究的进展与趋势.财经研究,2002(1))

第三节 宏观经济学的研究对象与研究方法

一、宏观经济学的研究对象

关于宏观经济学的研究对象,美国经济学家爱德华·夏皮罗在其《宏观经济学》中作了较为详细的阐述:“宏观经济学考察的是国民经济作为一个整体的功能,包括国民经济中物品和劳务的总量和资源的总利用量是如何决定的,以及引起这些总量波动的原因是什么。它力图说明:为什么有时候劳动力中的失业人数小到 3%,而另一些时候却大于 9%,甚至 9%以上;为什么有些时候国民经济的生产能力按工人、工厂、设备和技术知识