



云南大学研究生教学用书

Macroeconomics

宏观

经济学

郭树华 陈炳生 禄晓龙 编著

 云南大学出版社
YUNNAN UNIVERSITY PRESS



云南大学研究生教学用书

宏观经济学

郭树华 陈炳生 禄晓龙 编著

云南大学出版社

图书在版编目 (CIP) 数据

宏观经济学/郭树华, 陈炳生, 禄晓龙编著. —昆明:
云南大学出版社, 2007
ISBN 978-7-81112-392-0

I. 宏… II. ①郭… ②陈… ③禄… III. 宏观经济学—研
究生—教材 IV. F015

中国版本图书馆 CIP 数据核字 (2007) 第 120279 号

宏观经济学

郭树华 陈炳生 禄晓龙 编著

策划编辑: 蔡红华

责任编辑: 纳文汇 唐志成

封面设计: 刘 雨

责任校对: 何传玉

出版发行: 云南大学出版社

印 装: 云南国浩印刷有限公司

开 本: 787mm × 1092mm 1/16

印 张: 21

字 数: 378 千

版 次: 2007 年 8 月第 1 版

印 次: 2007 年 8 月第 1 次印刷

书 号: ISBN 978-7-81112-392-0

定 价: 39.00 元

社 址: 云南大学英华园内 (邮编: 650091)

发行电话: 0871-5033244 5031071

E-mail: market@ynup.com

网 址: <http://www.ynup.com>



郭树华 1989年毕业于中国社会科学院研究生院经济系经济管理专业，获经济学硕士学位。1999年毕业于中国人民大学经济系政治经济学专业，获经济学博士学位。主要研究宏观经济学、金融市场学、证券投资学。1998年被评为云南省中青年学术和技术带头人。现任云南大学经济学院副院长、硕士和博士研究生导师。主持（或参与）国家级和省级科研项目近30项，发表论文30多篇，出版著作4部。



陈炳生 云南大学经济学院党委副书记、副教授，主要研究宏观经济学、证券投资学。



禄晓龙 云南大学经济学院财税金融系经济学硕士，主要研究金融市场学、宏观经济学、投资学，曾参与省级、校级科研项目多项。



策划编辑：蔡红华
责任编辑：纳文汇
唐志成
封面设计：刘雨

目 录

第1章 绪 论	(1)
第一节 宏观经济学的内涵	(1)
一、什么是宏观经济学	(1)
二、宏观经济学研究的对象和主要问题	(2)
三、学习宏观经济学的意义	(3)
第二节 宏观经济学与微观经济学	(4)
第三节 宏观经济学的发展历程	(5)
一、简述	(5)
二、宏观经济学发展的早期阶段	(5)
三、宏观经济学发展的现代阶段	(6)
第四节 宏观经济分析方法	(9)
一、宏观经济学研究方法	(9)
二、建立经济学模型	(9)
三、模型中的经济变量	(9)
第五节 案例分析	(10)
【复习思考题】	(12)
第2章 国民收入核算	(13)
第一节 基本概念	(13)
一、国民生产总值 (GNP) 和国内生产总值 (GDP)	(13)
二、名义国内生产总值和实际国内生产总值	(15)
三、潜在的国内生产总值、实际的国内生产总值、GDP 缺口和奥肯定律	(15)
四、用国内生产总值衡量经济成果的缺陷	(16)

第二节 国民收入的核算方法	(16)
一、支出法	(16)
二、收入法	(17)
三、生产法	(17)
第三节 五大经济总量的核算关系	(18)
一、基本概念	(18)
二、基本公式	(19)
第四节 国民收入核算的基本经济恒等式	(19)
一、国民收入核算的基础	(19)
二、国民收入核算的基本经济恒等式	(20)
第五节 案例分析	(24)
【复习思考题】	(36)
第3章 国民收入决定理论	(39)
第一节 国民收入均衡公式	(39)
一、均衡国民收入的含义与国民收入的均衡条件	(40)
二、国民收入均衡公式	(40)
第二节 凯恩斯的消费理论	(41)
一、消费函数	(41)
二、储蓄函数	(43)
第三节 现代消费理论	(44)
一、杜森贝里的相对收入理论	(44)
二、生命周期消费理论	(45)
三、持久收入消费理论	(45)
四、家庭跨时期消费的基本理论	(46)
五、影响消费的因素	(49)
第四节 国民收入的决定	(51)
一、两部门经济中国民收入的决定	(51)
二、三部门经济中国民收入的决定	(52)
三、四部门经济中国民收入的决定	(53)
第五节 收入的变动：乘数理论	(55)
一、均衡收入变动的原因	(55)
二、两部门经济中的收入变动：投资乘数	(56)

三、三部门经济中的收入变动：政府购买乘数、税收乘数 与平衡预算乘数	(56)
四、四部门经济中的乘数	(59)
五、乘数理论的适用性	(60)
第六节 案例分析	(61)
【复习思考题】	(77)
 第4章 产品市场和货币市场的一般均衡	(80)
第一节 投资的决定	(80)
一、实际利率与投资	(80)
二、贴现率与重置成本	(81)
三、资本边际效率的意义	(82)
四、资本边际效率曲线与投资边际效率曲线	(83)
五、影响投资的因素：投资成本、投资收益与预期	(84)
六、托宾的“ q ”理论	(85)
第二节 IS 曲线	(86)
一、 IS 曲线的推导	(86)
二、 IS 曲线的斜率	(89)
三、三部门经济与四部门经济中的 IS 曲线	(89)
四、 IS 曲线的移动	(91)
第三节 货币的定义与货币市场	(91)
一、货币定义	(91)
二、货币和其他金融资产	(92)
三、古典学派的货币数量论	(93)
四、货币市场	(94)
五、资本市场	(94)
第四节 利率的决定与货币的需求	(95)
一、利率决定与货币的需求和供给	(95)
二、货币需求动机	(95)
三、流动偏好陷阱	(96)
四、货币需求函数与货币供给函数	(97)
五、货币供求均衡和利率的决定	(98)

第五节 LM 曲线	(100)
一、 LM 曲线及其推导	(100)
二、货币市场的自动均衡机制	(101)
三、 LM 曲线的斜率	(102)
四、 LM 曲线的移动	(103)
第六节 货币市场的均衡及其机制	(104)
一、货币市场的自动均衡过程	(104)
二、货币供给变动对货币市场均衡的影响	(105)
三、从货币市场到最终产品市场	(106)
第七节 两个市场的同时均衡	(107)
一、两个市场的同时均衡： $IS-LM$ 模型	(107)
二、均衡收入和利率的变动	(109)
三、 $IS-LM$ 模型与国民收入决定对应的总需求	(110)
第八节 $IS-LM$ 模型分析	(110)
一、 LM 曲线的移动	(111)
二、 IS 曲线的移动	(112)
第九节 凯恩斯经济理论的基本框架	(113)
一、凯恩斯经济理论纲要	(113)
二、凯恩斯经济理论的数学模型	(114)
三、凯恩斯理论说明	(115)
第十节 案例分析	(116)
【复习思考题】	(131)
 第5章 总需求—总供给模型	(134)
第一节 总需求曲线	(134)
一、总需求含义	(134)
二、总需求曲线的推导	(136)
三、总需求曲线的移动	(137)
第二节 总供给曲线	(139)
一、总供给曲线的含义	(139)
二、短期总供给曲线	(140)
三、总供给曲线的变动	(142)

第三节 总需求—总供给模型	(143)
一、总需求—总供给模型	(143)
二、总需求曲线变动时的均衡	(144)
三、总供给曲线变动时的均衡	(145)
四、通货膨胀及其对策	(146)
五、滞胀	(147)
第四节 案例分析	(148)
【复习思考题】	(155)
 第6章 宏观经济政策	(159)
第一节 宏观经济政策概况	(159)
一、宏观经济政策目标	(159)
二、宏观经济政策工具	(160)
三、宏观经济政策的发展与演变	(161)
第二节 需求管理（一）：财政政策	(162)
一、财政政策的内容与运用	(163)
二、内在稳定器	(164)
三、赤字财政政策	(164)
四、财政政策效果的 $IS-LM$ 图形分析	(165)
五、凯恩斯主义的极端情况	(167)
六、挤出效应	(168)
第三节 需求管理（二）：货币政策	(171)
一、货币政策的基本知识	(171)
二、凯恩斯主义的货币政策	(173)
三、货币主义的货币政策	(176)
四、货币政策效果的 $IS-LM$ 图形分析	(177)
五、古典主义的极端情况	(178)
六、货币政策的局限性	(179)
第四节 供给管理政策	(179)
一、收入政策	(180)
二、指数化政策	(181)
三、人力政策	(181)
四、经济增长政策	(182)

第五节 宏观经济政策的运用	(183)
一、菲利普斯曲线与政策目标的选择	(183)
二、财政政策与货币政策的配合	(184)
三、相机抉择	(185)
四、宏观经济政策实施中的困难	(186)
第六节 案例分析	(187)
【复习思考题】	(200)
第7章 失业与通货膨胀理论	(203)
第一节 失业理论	(203)
一、失业与充分就业	(203)
二、自然失业	(204)
三、周期性失业	(205)
四、隐蔽性失业	(206)
五、失业的经济损失	(206)
第二节 货币与通货膨胀的基本知识	(207)
一、货币与货币理论	(207)
二、通货膨胀及其衡量	(210)
第三节 通货膨胀理论	(211)
一、需求拉上的通货膨胀理论	(211)
二、供给推动的通货膨胀理论	(212)
三、供求混合推动的通货膨胀理论	(213)
四、结构性通货膨胀理论	(213)
五、预期的与惯性的通货膨胀理论	(214)
六、通货膨胀对经济的影响	(215)
第四节 失业与通货膨胀的关系	(216)
一、凯恩斯的观点：失业与通货膨胀不会并存	(216)
二、菲利普斯曲线：失业与通货膨胀之间的交替关系	(216)
三、菲利普斯曲线的预期模型	(219)
第五节 案例分析	(222)
【复习思考题】	(234)

第8章 经济增长与经济周期理论	(237)
第一节 经济增长理论概况	(237)
一、经济增长的含义与特征	(237)
二、经济增长理论的发展与现状	(238)
三、经济增长的源泉	(240)
第二节 经济增长模型	(243)
一、哈罗德—多马经济增长模型	(243)
二、新古典经济增长模型	(246)
三、新剑桥经济增长模型	(250)
四、新经济增长理论(内生增长理论)	(251)
五、经济增长因素的分析	(254)
第三节 经济周期	(255)
一、经济周期的含义	(255)
二、经济周期的类型	(256)
三、经济周期理论概述	(257)
四、乘数—加速数模型	(259)
第四节 案例分析	(261)
【复习思考题】	(276)
第9章 开放经济中的宏观经济学	(278)
第一节 开放经济与国际贸易	(278)
一、开放经济	(278)
二、国际贸易的有利影响	(279)
三、国际贸易的限制	(282)
第二节 国际收支	(283)
一、国际收支平衡表	(283)
二、国际收支调节理论	(286)
三、国际收支调节政策	(288)
四、净出口函数	(290)
五、净资本流出函数	(291)
六、国际收支平衡曲线	(291)
第三节 汇率理论	(293)
一、外汇和汇率	(293)

二、汇率的决定	(294)
三、汇率制度	(296)
第四节 $IS-LM-BP$ 模型	(298)
一、 $IS-LM-BP$ 模型	(298)
二、固定汇率制下开放的宏观经济政策	(299)
三、浮动汇率制下开放的宏观经济政策	(301)
四、调整国内均衡与国外均衡的政策	(302)
第五节 案例分析	(303)
【复习思考题】	(321)

第1章 绪 论

第一节 宏观经济学的内涵

一、什么是宏观经济学

宏观经济学 (macroeconomics) (在台湾普遍被译为“总体经济学”), 是以国民经济总过程的活动为研究对象, 着重考察和说明国民收入、就业水平、价格水平等经济总量是如何决定的、如何波动的, 故又被称为“总量分析经济学”或“总量经济学”。宏观经济学的研究对象是经济的总体行为。它的基本研究方法是考察经济的总体趋势, 采用总量分析法。它解决的中心问题是经济周期与失业、通货膨胀和经济增长。

宏观经济学是相对于古典的微观经济学而言的, 最早是挪威经济学家弗里希于 1933 年在《动态经济学中的传播问题与推动问题》一文 (伦敦, 1933) 中提出。20 世纪 80 年代以后, 新凯恩斯主义经济学兴起, 再次成为西方各国的政策基础, 而以新兴古典经济学的经济增长理论对经济增长的重视, 也在很大程度上改变着宏观经济学的内涵。目前, 国内宏观经济学的教学体系主要是以新凯恩斯经济学为主体。这一方面是受到西方经济学思潮的影响, 特别是受到曼昆等人的教科书的影响; 另一方面, 在我国宏观调控实践中, 以供给政策与需求政策相结合的调控是主线, 也是我国经济增长的最重要经验, 这构成了我国宏观经济学教学的实践背景。

二、宏观经济学研究的对象和主要问题

(一) 研究对象

宏观经济学以整个国民经济活动作为研究对象，即以国内生产总值、国内生产净值和国民收入的变动及就业、经济周期波动、通货膨胀、财政与金融、经济增长等之间的关系作为研究对象。

(二) 主要问题

宏观经济学一般包括国民收入均衡决定理论、就业理论、经济周期理论、通货膨胀理论、财政与金融理论、经济增长理论，等等。具体地说，它包括以下几个方面。

(1) 宏观经济的首要问题是商品和劳务产出的总水平。核算产出总量最常用的是国内生产总值。由于国内生产总值的变化与生产要素（主要是劳动和资本）投入水平的变化密切相关，所以工人的就业和失业水平、劳动力分配、资本的形成和利用，以及随着时间的变化，这些总量的变化情况也成为十分重要的问题。

(2) 宏观经济学另一个重要问题是解释商品价格水平的变化和通货膨胀率。综合物价指数，如消费者物价指数、生产物价指数，都是衡量国内生产总值中各个组成部分的平均价格的。

(3) 有关金融市场的分析集中在该市场上的交易量是如何与经济领域内其他方面的活动水平相互作用的。其研究的重心放在利息率和生息资产（股票、债券）价格的决定理论上。

(4) 国际收支往来包括商品和劳务的进出口水平、收支水平，以及两国货币之间的汇率。

(5) 政府应如何采取行动，尤其是如何利用政府支出、税收，以及货币和债券的发行来影响经济活动，也是一个重要的问题。

(6) 有关经济周期的分析是宏观经济学的重要内容之一。该分析表明，时间序列中一系列相关的经济变量是密切联系的，尤其是产出、就业、消费、投资、价格、实际工资和货币供给之间存在着内在的联系。给经济周期现象提供一个令人信服的和逻辑上一致的解释是宏观经济学的主要目标之一。

(7) 宏观经济学还有两个重要问题：一是研究阻碍实现帕累托最优配置的整体市场失灵的潜在根源。市场失灵的潜在根源可能在于价格体系无法包含所有互利的交换行为和各个经济主体缺乏能使交易优化的完备信

息。由于货币作为流通中介是典型的政府负债，所以也应考虑政府负债的管理、政府含息债券的发行和政府负债结构是否影响资源配置。二是资源最优跨时配置问题。

(8) 宏观经济政策的合理执行问题：假如认为宏观经济状况不很理想，这是否意味着政府行为能从某种程度上改善这一经济状况呢？如果政府的政策是有益的，那么什么样的政策又是最优的呢？有时政府的宏观经济政策是否有可能是完全无效率甚至是阻碍生产力的发展呢？

三、学习宏观经济学的意义

宏观经济学是从西方经济学中分离出来的一门经济学、管理学专业的专业基础课。在经济全球化、我国经济迅速发展的今天，科学技术日新月异，宏观经济学理论也是迅速更新，对实际经济生活的解释力也越来越强。宏观经济理论和现实经济活动息息相关、相辅相成：离开实际经济活动，宏观经济理论就成无源之水。同样，没有宏观经济理论的指导，经济活动就会相当盲目。这在国内外历史上是已经充分证明了的。

(一) 学习宏观经济学的理论意义

宏观经济学的学习，为经济学专业的学习提供了理论帮助，也为提高经济理论的素质提供了帮助；宏观经济学的学习，为将来的经济研究或编写宏观经济形势分析报告提供了良好的经济学基础；宏观经济学的学习，还为结合我国的实际，解决我国的宏观经济问题、进行理论研究，乃至创建具有中国特色的经济理论提供了理论帮助；科学研究的进展所取得的成果往往是积累性的，通过学习宏观经济学，会为将来其他经济学专业（例如财政学等）学习提供帮助；宏观经济学中的许多经济模型和经济规律尚未通过科学的实践检验，通过学习宏观经济学，了解需要进一步研究的问题，有利于科学研究的深化；结合我国的国情，借用宏观经济学的方法，特别是数学方法，有利于我国宏观经济调控者提出有理论依据的政策方针。

(二) 学习宏观经济学的实践意义

作为对国民经济进行间接调控的手段，宏观经济学关于财政政策和货币政策的理论有着实践指导意义；在条件能满足假设的要求时，宏观经济学中的某些具体的经济模型和公式可以为我们经济预测提供帮助；宏观经济学中的许多经济模型能够以比较形象的方法来说明我国所面临的经济问题；宏观经济学中的一些统计资料和国民经济数据，以及这些数据的使用

方法，为我们提供了参考。

第二节 宏观经济学与微观经济学

现代经济学常分为微观经济学和宏观经济学。前者研究个体经济规律，后者研究总量经济规律。宏观经济学与微观经济学的联系是：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。

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规律截然相反。比如，1970年诺贝尔经济学奖获得者、美国经济学家保罗·安·萨缪尔森（Paul A. Samuelson）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，如果某人把脚踮起来，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。

具体地说，宏观经济学与微观经济学有如下区别：

（一）研究对象不同

微观经济学的研究对象是单个经济单位。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。”而宏观经济学的研究对象则是整个经济。它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”。美国经济学家 E. 夏皮罗（E. Shapiro）则强调了“宏观经济学考察国民经济作为一个整体的功能”。

（二）解决的问题不同

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，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。

（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。而宏观经济学的研究方法则是总量分析，即对能够反映整个经济运行情况的经济变量的决定、变动及其相互关系进行分析。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，宏观经济学又称为“总量经济学”。