

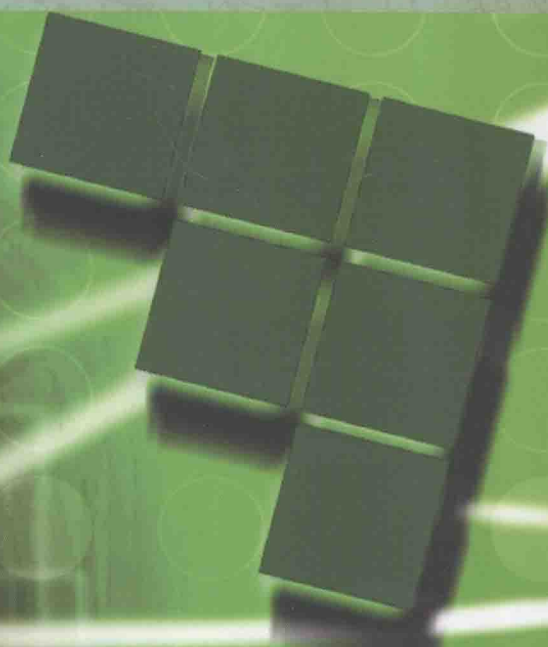
科学版精品课程立体化教材·经济学系列



# 宏观经济学

## (第二版)

主 编 任保平 宋 宇  
副主编 郭俊华 林建华



科学出版社

科学版精品课程立体化教材·经济学系列

# 宏观经济学

## (第二版)

任保平 宋 宇 主 编  
郭俊华 林建华 副主编

- 国家精品资源共享课教材
- 国家级精品课程教材
- 陕西省精品课程教材
- 教育部教育质量工程项目“理论经济学创新人才培养模式实验区”核心课程教材
- 教育部教育质量工程项目“教育部高等学校特色专业建设点”核心课程教材

科学出版社

北 京

## 内 容 简 介

“宏观经济学”是教育部确定的高等院校财经类专业的核心课程。本教材根据宏观经济学的基础、长期模型、短期模型、模型的扩展,以及宏观经济问题与政策五大部分建立课程体系结构,内容涉及国民收入核算、经济增长理论、总供给分析、总需求分析、宏观经济均衡模型、开放经济理论、消费理论、投资理论、预期理论、失业理论、通货理论、经济周期理论和宏观经济政策等。本教材参考了国内外多种教材,在理论体系构造上有所创新,以中国的事实为案例,形成了基于中国事实的理论。教材在体例上体现出“史-论-图”一体化,教材深度上偏向于中级教程,形成图像式和代数式相结合的教材模式。另外,教材形式上还附加了“专栏”“相关链接”等。

本教材可作为经济、管理、金融、财政以及其他财经类本科专业的基础课教材,同时也可供相关专业研究生、经济学研究者参考、阅读。

### 图书在版编目(CIP)数据

宏观经济学 / 任保平, 宋宇主编. —2 版. —北京: 科学出版社, 2016  
科学版精品课程立体化教材·经济学系列

ISBN 978-7-03-049725-3

I. ①宏… II. ①任… ②宋… 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 (2016) 第 199437 号

责任编辑: 张 凯 方小丽 / 责任校对: 邹慧卿

责任印制: 霍 兵 / 封面设计: 蓝正设计

科学出版社 出版

北京东黄城根北街 16 号

邮政编码: 100717

<http://www.sciencecp.com>

大厂书文印刷有限公司 印刷

科学出版社发行 各地新华书店经销

\*

2009 年 2 月第 一 版 开本: 787×1092 1/16

2016 年 8 月第 二 版 印张: 19 1/4

2016 年 8 月第九次印刷 字数: 451 000

定价: 39.00 元

(如有印装质量问题, 我社负责调换)

## 第二版前言

《宏观经济学》是 2008 年西方经济学被评为国家精品课程之后,西北大学经济管理学院西方经济学教学团队集体编写的一本教材,这部教材从 2009 年出版以来,在科学出版社的关心支持下,至今已经印刷了 8 次。被国内许多大学使用,取得了良好的效果。

但是,本教材在使用中也存在许多问题,一些参考资料变得陈旧,一些案例也显得过时。在科学出版社的支持下,我们启动了教材的再版,本次再版主要涉及以下方面:

第一,补充了一些新的材料。例如,第四章中将章标题改为“增长理论前沿”,第四节“劳动分工内生化的杨小凯-博兰德模型”因为内容在发展经济学中讲授,同时在硕士阶段也讲,再版中把这一节的内容改为“反增长理论”;并增加了第五节“增长质量理论”。

第二,更新了某些案例和相关链接。例如,第二章中把国民收入核算的一些相关链接数据进行了更新,第十三章中替换了专题 13-1。

第三,对全书中的相位图、公式进行了核实,改正了某些错误。对教材中一些错误的表述进行了修正。

本次修订主要由一些使用本教材的年轻教师来完成,郭晗博士完成了第一篇的修订,钞小静副教授负责了第二篇的修订,师博副教授负责了第三篇的修订,陕西师范大学的李娟伟负责了第四篇的修订,魏捷博士负责了第五篇的修订。在整体修订中,魏捷博士做了大量的协调工作。全书修订稿完成之后,我最后进行了全书的最终通稿。由于时间仓促,本教材虽然进行了认真修订,但是可能还会存在一些问题,欢迎读者提出批评意见。本次修订工作得到了科学出版社张凯编辑的支持和督促,在此也一并表示感谢。

任保平

2016 年 6 月于西北大学

# 第一版前言

西方经济学，包括微观经济学和宏观经济学，是财经类本科专业的基础课程和核心课程。学习该课程，可以为进一步学习财经类其他课程打下坚实的基础。该课程针对已具备高等数学知识的财经类本科生开设，为专业必修课。通过学习，要求学生认识并掌握微观经济学和宏观经济学的基本理论框架和分析逻辑，理解并弄清微观经济学和宏观经济学的基本概念，熟悉并掌握图形分析、实例分析以及简单的数学模型分析等基本分析方法和技巧，提高运用所学的经济学理论与分析工具分析和解决现实经济问题的能力。

## •本教材的课程背景

西北大学很早就开设了西方经济学课程，并将其设置为专业基础课程和重点建设课程。早在 20 世纪 80 年代，西北大学经济管理学院各专业就开设了西方经济学课程，最早由李瑞芝教授开设，此后邹东涛、赵增耀、杨小卿都讲授过西方经济学课程。

20 世纪 90 年代以来，随着经济学课程体系的改革，西方经济学分化为“宏观经济学”和“微观经济学”，分两学期开设，形成了以王忠民教授为主体的教学队伍，李树民、杨小卿、赵增耀、王小龙、范王榜、林建华都成为该课程的教学人员。

进入 21 世纪，随着人员的流动和人才的引进，教师队伍发生了新的变化。任保平教授、常云昆教授、李树民教授、严汉平教授、范王榜副教授、杨小卿副教授、宋宇副教授、郭俊华副教授、林建华博士、岳丽萍博士、王聪博士都成为西方经济学课程的主讲教师，形成了西方经济学课程教学团队，师资队伍进一步壮大，学历结构和职称结构进一步优化。

经过多年的建设，1998 年西方经济学成为国家理论经济学人才培养基地核心课程，2004 年成为西北大学精品课程和陕西省重点学科，2006 年成为陕西省精品课程，2007 年成为“教育部理论经济学创新人才培养模式实验区”核心课程、“教育部高等学校特色专业建设点”核心课程，2008 年被批准为“国家级精品课程”。随着教学实践的不断探索，西方经济学课程体系进一步完善，围绕“宏观经济学”“微观经济学”的教学，又进一步开设了“西方经济学流派”“西方经济学说史”“西方经济学前沿专题”等课程，

形成了较为完善的课程体系和结构合理的教学团队,在教学手段上充分利用现代教学设备,形成了较完善的多媒体教学手段。

#### •本教材的作者队伍及其分工

为了加强西北大学经济管理学院西方经济学精品课程的建设,在科学出版社的支持下,我们编写了本教材。《宏观经济学》教材的大纲是在任保平教授和宋宇副教授共同商量下确定的,各章初稿的编写分工如下:第一章,西北大学任保平;第二章,西北大学林建华;第三章,西北大学钞小静;第四章,西北大学邵晓;第五章,西北大学郭俊华;第六章,江苏大学汤向俊;第七章,西北大学张如意;第八章,西北大学林建华;第九章,西北大学宋宇;第十章,兰州商学院柳江;第十一章,西北大学宋宇;第十二章,西北大学蔡炳权;第十三章,西安科技大学王思薇;第十四章,西安理工大学王艳;第十五章,西北大学王聪。在各章初稿的基础上,任保平教授和宋宇副教授对全书进行了统稿工作,郭俊华副教授和林建华博士协助进行了部分章节的最终校对工作。

#### •本教材的特色

国内翻译了“宏观经济学”的许多国外原版教材,但是这些原版教材基本上是以美国案例为主的,难以解释国内的许多经济问题。同时各个高校也编写了自己的教材,但是这些教材基本上是以介绍为主,缺乏应用性。本教材在编写过程中,参考了国内外的多种教材,形成了以下特色:

(1)在理论体系上构建和现有体系不同的体系结构。在体系上将宏观经济学分为五大篇:第一篇为宏观经济学基础,包括宏观经济学概论和国民收入的核算及其决定两章;第二篇为宏观经济学的长期模型,包括经济增长理论及其基准模型、内生增长理论;第三篇为宏观经济学的短期模型,包括总供给与总需求、总需求理论和总供给理论;第四篇为宏观经济学模型的扩展,包括消费理论、投资理论、预期理论、开放经济的宏观均衡模型;第五篇为宏观经济问题与政策,包括失业理论、通货理论、经济周期理论和宏观经济政策。

(2)以中国的事实为案例,形成了基于中国事实的理论分析。现有的翻译教材以及国内编写的教材,大多数依据美国的案例来说明问题。本教材在编写过程中,许多理论力求以中国的案例来说明。例如,在第二章“国民收入的核算及其决定”中,不仅以美国的例子来说明,而且以中国2006年的数据来说明支出法GDP的核算及其结构。在第六章IS-LM模型中,不仅介绍了这一模型的内容,而且在“专栏”中介绍了“中国的IS-LM模型及其政策分析”。

(3)本教材在深度上偏向于中级教程,形成图像式和代数式相结合的教材模式。例如,在经济增长理论中,现有教材主要介绍新古典模型,而本教材在介绍新古典模型的基础上,进一步介绍了新古典经济增长模型的扩展,同时介绍了内生增长诸模型,包括技术内生的阿罗-谢辛斯基模型、知识内生的罗默模型、人力资本内生的卢卡斯模型、分工内生的杨小凯-博兰德模型。不仅介绍了这些模型的思想,而且介绍了模型的推导过程,从而便于学生在初级教程学习的基础上向中级过渡。

(4)教材体例上体现出“史-论-图”一体化。在教材形式上,附加了“专栏”“相关链接”等形式。扩展性知识通过“专栏”形式来介绍。例如,在介绍经济增长理论中,

通过“专栏”介绍“经济增长的要素贡献的计算”；在消费理论中，通过“专栏”介绍“中国目前的消费态势及其解释”；在失业理论中，通过“专栏”介绍“中国失业率计算”。对于补充性知识通过“相关链接”来处理。例如，在经济增长理论中，通过“相关链接”介绍“反增长理论”；在总需求理论中，通过“相关链接”介绍“中国总需求结构的现状分析”。

由于水平和认识上的局限性，本教材难免存在各种不足，欢迎读者和各位同行批评指正。

#### •致谢

在教材编写过程中，我们参考了近年来国际和国内出版的同类教材，吸收了各家长处，参考的教材和书目在各章最后的主要“扩展性阅读资料”中列出，在此表示感谢。

本教材的编写以西北大学经济管理学院西方经济学教学团队为主体，同时得到了西安理工大学、兰州商学院、西安科技大学和江苏大学的支持。此外，本教材是“国家级精品课程教材”、“陕西省精品课程教材”、教育部教育质量工程项目“理论经济学创新人才培养模式创新实验区”核心课程教材和“教育部高等学校特色专业建设点”核心课程教材。在教材编写过程中得到了西北大学教务处和经济管理学院的大力支持，西北大学副校长任宗哲教授、经济管理学院院长白永秀教授、教务处处长王正斌教授给予了积极的鼓励和支持，在此表示感谢。同时，也得到了陕西省外国经济学学说研究会会长冯涛教授、副会长常云昆教授以及经济管理学院李树民教授等的支持，在此一并表示感谢。最后，科学出版社的林建编辑为本教材的出版付出了辛勤的劳动，并在大纲形成和教材的思路提供了许多建设性的意见，在此表示感谢。

任保平

2008年12月于西北大学



## 第一篇 宏观经济学基础

### 第一章

|                            |    |
|----------------------------|----|
| 宏观经济学概论 .....              | 3  |
| 第一节 宏观经济学的基本问题 .....       | 3  |
| 第二节 宏观经济学的基本假设和研究方法 .....  | 7  |
| 第三节 宏观经济学的基本变量关系 .....     | 9  |
| 第四节 宏观经济问题 .....           | 11 |
| 第五节 宏观经济学理论体系的演变与新进展 ..... | 13 |
| 本章提要 .....                 | 17 |
| 关键概念 .....                 | 18 |
| 复习思考题 .....                | 18 |
| 扩展性阅读资料 .....              | 18 |

### 第二章

|                         |    |
|-------------------------|----|
| 国民收入的核算及其决定 .....       | 19 |
| 第一节 国民收入的核算 .....       | 19 |
| 第二节 国民收入的流量循环模型 .....   | 27 |
| 第三节 国民收入均衡的决定及其变动 ..... | 30 |
| 本章提要 .....              | 35 |
| 关键概念 .....              | 36 |
| 复习思考题 .....             | 36 |
| 扩展性阅读资料 .....           | 36 |



## 第二篇 宏观经济学的长期模型

### 第三章

|                        |    |
|------------------------|----|
| 经济增长理论及其基准模型           | 39 |
| 第一节 经济增长的基本问题          | 39 |
| 第二节 早期的经济增长模型：哈罗德-多马模型 | 44 |
| 第三节 经济增长的基准模型：新古典模型    | 49 |
| 第四节 经济增长基准模型的扩展        | 57 |
| 第五节 基准模型的困境            | 61 |
| 本章提要                   | 61 |
| 关键概念                   | 62 |
| 复习思考题                  | 62 |
| 扩展性阅读资料                | 62 |

### 第四章

|                            |    |
|----------------------------|----|
| 增长理论前沿                     | 63 |
| 第一节 内生增长理论概述               | 63 |
| 第二节 单部门内生增长模型：“干中学”与知识外溢模型 | 65 |
| 第三节 考虑人力资本外部性的内生增长模型       | 68 |
| 第四节 反增长理论                  | 70 |
| 第五节 增长质量理论                 | 72 |
| 本章提要                       | 73 |
| 关键概念                       | 74 |
| 复习思考题                      | 74 |
| 扩展性阅读资料                    | 75 |

## 第三篇 宏观经济学的短期模型

### 第五章

|                   |     |
|-------------------|-----|
| 总供给与总需求           | 79  |
| 第一节 总需求分析         | 79  |
| 第二节 总供给分析         | 84  |
| 第三节 宏观经济的短期均衡及其波动 | 88  |
| 第四节 宏观经济的均衡模型     | 94  |
| 本章提要              | 99  |
| 关键概念              | 100 |
| 复习思考题             | 100 |
| 扩展性阅读资料           | 100 |

## 第六章

|                      |     |
|----------------------|-----|
| 总需求理论 .....          | 102 |
| 第一节 金融市场及利率的决定 ..... | 102 |
| 第二节 IS-LM 曲线 .....   | 114 |
| 第三节 外部冲击与总需求 .....   | 123 |
| 本章提要 .....           | 125 |
| 关键概念 .....           | 126 |
| 复习思考题 .....          | 126 |
| 扩展性阅读资料 .....        | 127 |

## 第七章

|                         |     |
|-------------------------|-----|
| 总供给理论 .....             | 128 |
| 第一节 短期总供给模型 .....       | 128 |
| 第二节 外部冲击与总供给曲线的移动 ..... | 138 |
| 第三节 菲利普斯曲线与总供给 .....    | 140 |
| 本章提要 .....              | 147 |
| 关键概念 .....              | 147 |
| 复习思考题 .....             | 148 |
| 扩展性阅读资料 .....           | 148 |

## 第四篇 宏观经济学模型的扩展

## 第八章

|                         |     |
|-------------------------|-----|
| 消费理论 .....              | 151 |
| 第一节 凯恩斯的消费函数及消费之谜 ..... | 151 |
| 第二节 弗里德曼的持久性收入假说 .....  | 155 |
| 第三节 莫迪利亚尼的生命周期假说 .....  | 157 |
| 第四节 杜森贝的消费理论 .....      | 160 |
| 本章提要 .....              | 162 |
| 关键概念 .....              | 162 |
| 复习思考题 .....             | 163 |
| 扩展性阅读资料 .....           | 163 |

## 第九章

|                   |     |
|-------------------|-----|
| 投资理论 .....        | 165 |
| 第一节 投资决策 .....    | 165 |
| 第二节 投资模型 .....    | 170 |
| 第三节 总投资需求函数 ..... | 172 |
| 第四节 投资的形式 .....   | 173 |

|              |     |
|--------------|-----|
| 本章提要.....    | 176 |
| 关键概念.....    | 177 |
| 复习思考题.....   | 177 |
| 扩展性阅读资料..... | 177 |

## 第十章

|                      |     |
|----------------------|-----|
| 预期理论.....            | 178 |
| 第一节 预期理论的演进.....     | 178 |
| 第二节 理性预期的宏观经济模型..... | 181 |
| 本章提要.....            | 192 |
| 关键概念.....            | 192 |
| 复习思考题.....           | 192 |
| 扩展性阅读资料.....         | 193 |

## 第十一章

|                  |     |
|------------------|-----|
| 开放经济的宏观均衡模型..... | 194 |
| 第一节 开放经济概述.....  | 194 |
| 第二节 长期开放模型.....  | 198 |
| 第三节 短期开放模型.....  | 201 |
| 本章提要.....        | 212 |
| 关键概念.....        | 212 |
| 复习思考题.....       | 212 |
| 扩展性阅读资料.....     | 213 |

## 第五篇 宏观经济问题与政策

## 第十二章

|                    |     |
|--------------------|-----|
| 失业理论.....          | 217 |
| 第一节 失业及其成本.....    | 217 |
| 第二节 失业与职业搜寻理论..... | 223 |
| 第三节 工资刚性模型.....    | 227 |
| 第四节 失业的治理.....     | 231 |
| 本章提要.....          | 234 |
| 关键概念.....          | 234 |
| 复习思考题.....         | 234 |
| 扩展性阅读资料.....       | 235 |

## 第十三章

|                         |     |
|-------------------------|-----|
| 通货理论.....               | 236 |
| 第一节 通货膨胀及其类型.....       | 236 |
| 第二节 通货膨胀的形成机制的理论解释..... | 240 |
| 第三节 通货紧缩及其治理.....       | 250 |
| 本章提要.....               | 252 |
| 关键概念.....               | 252 |
| 复习思考题.....              | 253 |
| 扩展性阅读资料.....            | 253 |

## 第十四章

|                     |     |
|---------------------|-----|
| 经济周期理论.....         | 254 |
| 第一节 经济周期的基本问题.....  | 254 |
| 第二节 乘数-加速数模型.....   | 260 |
| 第三节 经济周期理论的新进展..... | 263 |
| 本章提要.....           | 270 |
| 关键概念.....           | 271 |
| 复习思考题.....          | 271 |
| 扩展性阅读资料.....        | 271 |

## 第十五章

|                      |     |
|----------------------|-----|
| 宏观经济政策.....          | 272 |
| 第一节 政府的宏观经济行为.....   | 272 |
| 第二节 宏观经济政策的作用机制..... | 277 |
| 第三节 宏观经济政策的争论.....   | 284 |
| 本章提要.....            | 286 |
| 关键概念.....            | 287 |
| 复习思考题.....           | 287 |
| 扩展性阅读资料.....         | 288 |

## 相关链接目录

|           |                                      |     |
|-----------|--------------------------------------|-----|
| 相关链接 1-1  | 对宏观经济学微观基础的探寻.....                   | 6   |
| 相关链接 1-2  | 1978 年以来中国的 GDP、人均 GDP 以及经济增长率 ..... | 9   |
| 相关链接 2-1  | 美国和中国支出法的 GDP 及其构成 .....             | 21  |
| 相关链接 2-2  | 美国 2010 年收入法的 GDP 及其构成 .....         | 24  |
| 相关链接 2-3  | 绿色国民账户体系 .....                       | 26  |
| 相关链接 3-1  | 改革 30 多年来中国经济增长奇迹的不同解释 .....         | 42  |
| 相关链接 3-2  | 水平量的变化与变化率 .....                     | 43  |
| 相关链接 4-1  | 内生变量与外生变量 .....                      | 64  |
| 相关链接 5-1  | 中国总需求结构 .....                        | 80  |
| 相关链接 5-2  | 滞胀的原因和特征 .....                       | 93  |
| 相关链接 6-1  | 货币的基础知识 .....                        | 104 |
| 相关链接 6-2  | 货币乘数及其决定因素 .....                     | 107 |
| 相关链接 7-1  | 总供给的三种形式 .....                       | 128 |
| 相关链接 8-1  | 关于中国消费函数的研究 .....                    | 154 |
| 相关链接 9-1  | 投资对经济增长影响的分析方法 .....                 | 166 |
| 相关链接 9-2  | 1978 年以来中国固定资产投资与经济增长 .....          | 172 |
| 相关链接 10-1 | 信息与预期 .....                          | 183 |
| 相关链接 11-1 | 1978~2007 年中国进出口情况 .....             | 194 |
| 相关链接 11-2 | 中国国际收支的变化 .....                      | 195 |
| 相关链接 12-1 | 奥肯定律 .....                           | 223 |
| 相关链接 13-1 | 中国的双膨胀：通货膨胀与资产价格膨胀 .....             | 247 |
| 相关链接 13-2 | 中国通货膨胀的测度 .....                      | 249 |
| 相关链接 14-1 | 凯恩斯的经济周期理论 .....                     | 259 |
| 相关链接 15-1 | 货币政策的传导机制 .....                      | 281 |

## 专栏目录

|         |                         |     |
|---------|-------------------------|-----|
| 专栏 1-1  | 经济学研究的假设.....           | 7   |
| 专栏 2-1  | 物质产品平衡体系与国民账户体系.....    | 20  |
| 专栏 2-2  | 测量经济福利的指标.....          | 26  |
| 专栏 3-1  | 模型化之前的经济增长思想.....       | 48  |
| 专栏 4-1  | 中国经济增长与技术进步.....        | 66  |
| 专栏 5-1  | 居民消费价格指数.....           | 81  |
| 专栏 6-1  | 中国的 IS-LM 模型及其政策分析..... | 120 |
| 专栏 7-1  | 潜在总供给的计算.....           | 138 |
| 专栏 7-2  | 中国的菲利普斯曲线.....          | 144 |
| 专栏 8-1  | 中国的假日经济与消费.....         | 156 |
| 专栏 8-2  | 中国目前的消费态势及其解释.....      | 161 |
| 专栏 9-1  | 住房投资的定义.....            | 175 |
| 专栏 9-2  | 中国的房地产投资.....           | 176 |
| 专栏 10-1 | 理性预期下的蛛网模型.....         | 182 |
| 专栏 10-2 | 卢卡斯总供给方程的数学推导.....      | 191 |
| 专栏 11-1 | 人民币升值有什么不利和有利的影         | 202 |
| 专栏 12-1 | 中国失业率计算.....            | 221 |
| 专栏 12-2 | 奥肯定律与中国的失业.....         | 232 |
| 专栏 13-1 | 价格指数.....               | 239 |
| 专栏 14-1 | 中国的经济周期.....            | 264 |
| 专栏 14-2 | 痛苦指数.....               | 265 |
| 专栏 15-1 | 2008 年中国的宏观经济政策.....    | 283 |

# 第一篇

## 宏观经济学基础





# 第一章

## 宏观经济学概论

宏观经济学又称总体经济学、大经济学，是微观经济学的对称。宏观经济学是现代西方经济学的一个分支，它以整个国民经济为考察对象，研究经济中各有关总量的决定及其变动，以解决失业、通货膨胀、经济波动、国际收支等宏观问题，实现经济长期稳定的发展。本章主要研究宏观经济学的基本问题、基本假设、研究方法、宏观经济学理论体系的演化及其新进展。

### 第一节 宏观经济学的基本问题

#### 一、宏观经济学的研究对象

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做出经济解释，对社会福利的影响和政府政策可能发挥的作用进行分析。

宏观经济学围绕经济运行的四大目标展开：①提高经济增长；②降低失业率；③降低通货膨胀率；④平衡国际收支。四大目标之间相互联系、相互区别，在四大目标中，经济增长是主要的基础性目标。

#### 二、宏观经济学的内容

宏观经济学一般研究四个层次的内容：①宏观经济学的基本理论，包括国民收入决定理论、总供给理论、总需求理论、总供给和总需求的均衡理论、消费理论、投资理论、货币理论、经济增长理论、开放经济理论等。②宏观经济模型，主要包括各个流派建立