

Macroeconomics

西方经济学

宏观部分

韩民春 ©主编



北京大学出版社
PEKING UNIVERSITY PRESS

Macroeconomics

西方经济学

宏观部分

韩民春 ◎主 编

许小平 张玉英 ◎副主编



北京大学出版社
PEKING UNIVERSITY PRESS

图书在版编目(CIP)数据

西方经济学(宏观部分)/韩民春主编. —北京:北京大学出版社,2007.11
ISBN 978-7-301-12708-7

I. 西… II. 韩… III. 现代资产阶级经济学-高等学校-教材
IV. F091.3

中国版本图书馆 CIP 数据核字(2007)第 136771 号

书 名: 西方经济学(宏观部分)

著作责任者: 韩民春 主编

责任编辑: 张静波

标准书号: ISBN 978-7-301-12708-7/F·1710

出版发行: 北京大学出版社

地 址: 北京市海淀区成府路 205 号 100871

网 址: <http://www.pup.cn> 电子邮箱: em@pup.pku.edu.cn

电 话: 邮购部 62752015 发行部 62750672 编辑部 62752926

出版部 62754962

印 刷 者: 三河市新世纪印务有限公司

经 销 者: 新华书店

730 毫米×980 毫米 16 开本 18 印张 284 千字

2007 年 11 月第 1 版 2007 年 11 月第 1 次印刷

印 数: 0001—4000 册

定 价: 26.00 元

未经许可,不得以任何方式复制或抄袭本书之部分或全部内容。

版权所有,侵权必究

举报电话:010-62752024 电子邮箱:fd@pup.pku.edu.cn

前言

改革开放后,西方经济学正式进入中国大学课堂已有二十年左右的时间,先后有许多的中国学者编著了以此为书名的教材,为中国学生了解西方的经济学做出了巨大的贡献。近些年,更是引进、翻译了大量国外优秀的教材,供不同层次的学生选读,使学生们能够全面把握国外经济学领域的成熟理论和最新进展。因此,在这样的背景下编著出版西方经济学教材是一项具有挑战性的工作。我们之所以选择这项工作,主要基于以下几方面的原因:第一,目前部分西方经济学教材内容比较陈旧,不能反映近些年国外经济学教学领域的新思想。第二,不少教材偏重理论阐述,缺乏针对当前经济现象的经济分析,不利于学生理论联系实际。此外,更加缺乏结合当前中国经济的案例分析。第三,目前的教材难度两极分化,缺乏适合于中高层次应用型人才培养的、难度适中的教材。

因此,本教材的编写突出了以下几个方面的特点:

1. 以教育部西方经济学教学大纲为基础,加以扩充和完善,强调知识的系统性、逻辑性、应用性,并且使读者能够适应有关的考试。
2. 教材的内容综合了目前国内外主流教材的思想,既吸收了国外著名经济学家的经典教材的部分内容,同时也反映了中国学者在这一

领域的教学和研究成果。

3. 教材尝试着用经济学的理论来分析当前中国经济发展中的一些问题,引导学生将理论

与实际相结合。

本教材适用于大学经济管理等相关专业的本、专科学生,以及对西方经济学感兴趣的读者,帮助他们了解和学习西方经济学基本理论,其难度介于中级和初级之间。

本教材宏观部分由以下人员分别负责编写:

韩民春负责第三、四、五、八、九章,许小平负责第一、二、六、七章,徐姗、刘红梅、牛军和袁秀林分别负责第三、四、五、九章的资料整理和修订工作,吕慧娟参与编写了第一、二、六、七章。

本教材虽经过近两年多的时间编写、修订,但是由于西方经济学理论博大精深、体系十分庞大、内容十分丰富,因此,难免还会存在许多疏漏和不足,我们将会不断修订和完善。

编者

2007年1月

目录 contents

导论 宏观经济学概述 / 1

第一章 国民收入核算 / 4

- 第一节 宏观经济运行的特点 / 4
- 第二节 国民收入核算方法 / 7
- 第三节 国民收入构成的基本公式 / 15
- 第四节 名义 GDP 和实际 GDP / 18

第二章 国民收入的决定 / 24

- 第一节 消费函数和储蓄函数 / 24
- 第二节 简单国民收入决定理论 / 30
- 第三节 乘数理论 / 38

第三章 产品市场和货币市场的均衡:IS-LM 模型 / 53

- 第一节 投资理论 / 53
- 第二节 产品市场的均衡:IS 曲线 / 59
- 第三节 利率的决定 / 64
- 第四节 货币市场的均衡:LM 曲线 / 69
- 第五节 产品、货币市场的一般均衡:IS-LM 分析 / 74
- 第六节 IS-LM 模型与财政政策和货币政策效果 / 78

第四章 总需求与总供给分析 / 86

- 第一节 总需求曲线 / 86
- 第二节 总供给曲线 / 94
- 第三节 总需求—总供给(AD-AS)模型 / 102

第五章 宏观经济政策 / 117

- 第一节 宏观经济政策概述 / 117
- 第二节 财政政策 / 120

第三节 货币政策 / 126

第四节 财政政策和货币政策的搭配使用 / 135

第五节 供给管理政策 / 139

第六章 通货膨胀与失业 / 150

第一节 通货膨胀的类型及其影响 / 150

第二节 通货膨胀的原因 / 157

第三节 失业理论 / 166

第四节 菲利普斯曲线 / 173

第七章 经济增长理论 / 183

第一节 经济增长理论概述 / 183

第二节 哈罗德-多马模型 / 186

第三节 新古典经济增长模型 / 191

第四节 经济增长因素分析 / 196

第五节 经济增长周期 / 206

第八章 开放条件下的宏观经济

——国际贸易理论发展概述 / 216

第一节 古典国际贸易理论 / 216

第二节 要素禀赋理论 / 219

第三节 新贸易理论 / 220

第九章 开放条件下的宏观经济

——国际金融理论概述 / 223

第一节 汇率 / 224

第二节 国际收支平衡表 / 229

第三节 资本流动和开放经济中的 IS-LM 模型 / 236

第四节 国际货币制度演变概述 / 245

部分参考答案 / 261

主要参考文献 / 279

导论 宏观经济学概述

一、宏观经济学的内容

宏观经济学是相对微观经济学而言的。微观经济学利用微观或个体分析方法,以价格分析为中心,主要研究单个经济单位的经济行为及其后果,因此又称为个体经济学。宏观经济学则是利用宏观或总量分析方法,将国民收入和就业分析作为研究中心,来研究社会总体的经济行为及其后果。它所研究的都是带有总量意义的变量或范畴,如一国总产出、一国总收入、一国总支出、就业总人数、价格水平等,所以又被称为总量经济学。

现代西方宏观经济学主要是在 20 世纪 30 年代以后发展起来的,在那之前,经济学家们所强调的基本上都是以价格或资源配置分析为中心的微观经济学。宏观经济学之所以不被重视,主要是因为当时流行的古典经济理论虽然认为一国的经济并不会总是处于充分利用资源或充分就业的状态,但它认为经济波动只是暂时的,市场机制的自发力量可以很快把就业量和产量调整到充分就业时的水平。然而,20 世纪 30 年代的大萧条彻底推翻了古典经济理论,当时的经济形势迫使西方经济学家们对经济运行研究的着眼点由微观个体转向宏观整体,从而提出新的理论为政府结束那场大萧条出谋划策。1936 年英国著名经济学家凯恩斯出版了《就业、利息与货币通论》一书,该书被认为是第一部系统地运用总量分析方法来研究整个国民经济活动的宏观经济学著作,它为西方宏观经济学后来的发展奠定了基础。

二、宏观经济学研究的主要内容

宏观经济学的本质在于考察国民经济作为一个整体的功能,而一国国

民经济运行的好坏一般主要从国民产出、就业、价格水平和对外贸易四个方面进行评价,因此,宏观经济学研究的内容也主要体现在这几个方面。概括而言,其分析的基本问题包括:

1. 国民产出与经济增长的问题

一个国家的经济实力和经济成就最终是以国民产出水平和增长速度为标志的,因此,维持实际国民产出的高水平 and 稳定的经济增长,不仅是一国基本的宏观经济目标,也是宏观经济学的研究中心。对这一问题的分析可以从短期、中期、长期三个角度进行,即短期内一国总产出水平如何决定、一个经济周期中国民产出的波动怎样形成,以及长期看一国的国民经济又是如何实现增长的。这里,宏观经济学要解决的问题包括:如何提高一国资源的利用程度,从而使实际总产出接近或达到充分就业时的产出水平;怎样使经济尽可能地避免剧烈波动,而沿着比较平稳的路线向前发展;如何保持国民经济高速、稳定的增长等。

2. 关于就业的问题

宏观经济学关注的是一国总的就业水平,就业与产出密切相关,也是宏观经济学研究的重点。在市场经济国家,即使是在高产出的经济繁荣时期,也难免存在失业问题。较低的失业率是可以接受的,但如果失业率过高,不仅会对国民产出造成负面影响,而且也会带来一系列的心理与社会问题。因此,分析失业的原因、影响以及反失业政策,从而尽量使劳动力实现充分就业也是宏观经济学研究的重要问题。

3. 价格水平与通货膨胀的问题

宏观经济学研究的是一国物价总水平。虽然在市场经济中,价格水平的波动是常见的现象,但实践证明,价格水平的大幅提高即通货膨胀对一国经济的运行非常有害。那么,造成通货膨胀的原因是什么?政府又该采取怎样的措施来维持价格水平的稳定,以保证国民经济的健康发展呢?这已经成为宏观经济学家们讨论的另一课题。

4. 关于汇率与国际收支的问题

在当今世界,几乎所有的国家都是开放型经济,国际经济环境与经济体系的变化都会对一国的经济运行产生影响。因此,宏观经济学选择从汇率和国际收支两方面来分析,其研究的主要内容包括:如何实现保持汇率稳定和国际收支平衡的宏观经济目标,汇率和国际收支的变化又将对国民产

出、就业和价格水平造成怎样的影响等。

5. 关于宏观经济政策的问题

上述几方面的问题不仅是宏观经济学研究的主要内容,也是一国追求的主要宏观经济目标。而要实现这些目标,就不可避免地要借助各种宏观经济调控手段。事实上,自凯恩斯理论出现以后,政府干预就一直在国民经济运行中扮演着重要的角色,西方各国政府都开始利用财政政策、货币政策、收入政策、对外经济政策等手段来实现宏观经济目标。所以,研究宏观经济政策对国民经济运行的影响,以及如何利用这些政策来实现既定的经济目标,也是目前宏观经济学要回答的问题。

三、宏观经济学与微观经济学

虽然宏观经济学与微观经济学在研究对象、研究内容和研究方法上都存在很大差异,但它们并不是孤立的两个体系。在实践中,对经济问题的研究往往要将宏观分析与微观分析相结合。微观经济学在研究资源的有效配置时,要以经济达到充分就业的状态为前提;而宏观经济学在研究资源总量的充分利用时,则要以微观资源的有效配置为前提。还需要指出的是,因为对总体经济行为的分析离不开对个体经济行为的分析,因此,宏观经济学的总量研究总是以一定的微观主体行为研究为基础的。可以说,宏观经济学与微观经济学是相互补充、互为前提的两个部分,它们共同组成了西方经济学这个整体。

第一章 国民收入核算

本章要点

- 宏观经济运行的特点
- 国民收入核算方法

宏观经济学是从整体考察国民经济运行及其规律的一门科学,它研究经济总量的决定及其变动,并在此基础上解决总体宏观经济问题。在国民经济的众多总量中,国民收入是最具有代表性的经济总量。因此,研究国民收入的决定因素及其决定过程,就构成了宏观经济理论的基本问题。不过,在进一步分析宏观经济的运行规律之前,首先必须掌握如何衡量国民经济收入,即怎样进行国民经济核算。本章在介绍宏观经济学的定义及其研究内容的基础上,分析国民经济的收入流量循环,以及国民收入核算体系中主要总量指标的定义、计算和评价问题。

第一节 宏观经济运行的特点

要分析一个国家的宏观经济运行情况,首先必须研究该国的国民收入核算。国民收入核算力求通过对一国在一定时期内总收入及商品与劳务的总测算来衡量该国经济运行的效果。在这一节里,我们主要讨论核算体系中相关概念的定义、核算指标的选择和核算方法,从而为以后的宏观经济

分析奠定基础。在研究上述问题之前,有必要先对宏观经济的运行特点进行初步的介绍。

一、两部门经济中宏观经济运行的特点

我们首先从最简单的经济体系入手。这种经济模型假定一国经济是封闭型的,与其他国家没有任何经济关系,并且不考虑政府的经济活动。因此,这种经济体系主要由居民户和企业两部门构成,即所谓的两部门经济。

在这个经济体系中,居民向企业提供生产要素,同时购买企业生产的产品与劳务;企业雇用居民提供的生产要素,并出售产品与劳务。两个部门之间通过生产要素市场、产品市场以及金融市场进行联系。

两部门经济的运行特点可用图 1-1 表示。在生产要素市场上,居民向企业部门提供劳动、土地、资本、企业家才能等生产要素;企业则向居民支付生产要素的报酬,包括劳动者的工资、土地的使用租金、资本的利息以及企业所有者的利润。在产品市场上,企业生产并向居民提供各种消费品与劳务,居民则通过产品市场进行消费支出。在金融市场上,居民将未用于消费的收入进行储蓄,企业则通过金融市场获得投资所需要的资金。

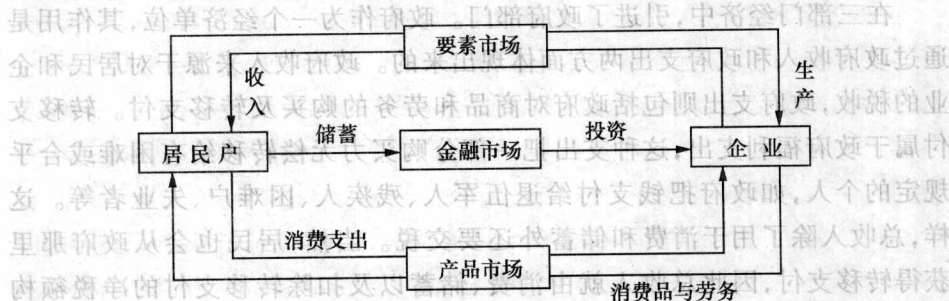


图 1-1 两部门经济的运行特点

在两部门经济中,企业向居民支付的生产要素报酬即为居民户部门的总收入,这里用 Y 表示。居民将其收入的一部分用于产品和劳务的消费 (C),另一部分则通过储蓄 (S) 进入金融市场。此时,总收入由消费和储蓄构成。而当企业生产出最终产品和劳务后,它将总产出的一部分出售给居民,另一部分则形成存货投资。因此,在两部门经济中,总支出是消费支出与投资的总和。

通过上面的分析不难知道,社会的产出总是等于总收入,同时也等于总支出。一方面,企业在生产过程中必须为使用要素而支付费用,如使用劳动力要付工资,使用土地要付租金,使用资本要付利息。所以说,产品和劳务的价值总是分割为各个生产要素所有者的收入,有1元钱的产出,就有1元钱的收入与之对应。将千万个企业的生产情况加总起来,从全社会的角度看,总产出等于总收入。关于这一点,也可以由图1-1的上半部分反映出来。另一方面,购买者对最终产品和劳务进行的总支出,即为企业的销售收入,也就是其创造的最终产品和劳务的总价值。因此,总产出不仅等于总收入,它也等于总支出。那么,如果社会某年生产了1亿美元的最终产品,却只卖掉0.9亿美元产品,此时总产出是否还等于总支出呢?答案是肯定的。因为在西方国民经济核算中,这没有卖掉的0.1亿美元产品被看做是本企业在存货方面的投资支出,即前面提到的存货投资。由于存货变化被认为是企业购买自己产品的投资支出,所以此时的总支出就为1亿美元,它仍然等于总产出。

二、三部门经济和四部门经济中宏观经济运行的特点

在三部门经济中,引进了政府部门。政府作为一个经济单位,其作用是通过政府收入和政府支出两方面体现出来的。政府收入来源于对居民和企业的税收,政府支出则包括政府对商品和劳务的购买及转移支付。转移支付属于政府福利支出,这种支出把一部分购买力无偿转移给有困难或合乎规定的个人,如政府把钱支付给退伍军人、残疾人、困难户、失业者等。这样,总收入除了用于消费和储蓄外还要交税。当然,居民也会从政府那里获得转移支付,因此总收入就由消费、储蓄以及扣除转移支付的净税额构成。相应地,总支出则由消费、投资和政府购买组成。

在四部门经济中,除了政府部门,还引入了与其他国家的对外贸易活动。现实中的经济大多是四部门经济。此时,国外部门作为一个经济单位,它一方面购买国内的产品和劳务,对本国来说形成出口;另一方面,国外部门也向国内销售产品和劳务,对本国来说形成进口。此时,总收入由消费、储蓄和扣除转移支付的净税额构成。而总支出除了包括消费、投资和政府购买外,还包括净出口额。要指出的是,不管是在三部门还是在四部门经济中,社会的总产出都等于总收入,也等于总支出,其原因与两部门

的宏观经济运行相同,这里不再重复。

第二节 国民收入核算方法

国民收入核算是指定义和计量国民收入的一套规则和方法。在进一步讨论这套规则和方法之前,首先必须了解核算所涉及的指标。下面我们就从国民收入核算体系中的基本指标——国内生产总值开始介绍。

一、国内生产总值的含义

在市场经济国家,核算国民经济活动的核心指标是国内生产总值(简称 GDP)。国内生产总值是指一国或一地区在一定时期内运用生产要素所生产的全部最终产品和劳务的价值总和。要准确理解这一定义,必须注意以下几点:

1. 最终产品与劳务和价值增值

GDP 核算的是最终产品与劳务的价值,选择用最终产品和劳务来计算国内生产总值的目的是避免重复核算。企业生产出来的产品和劳务可分为最终产品和劳务以及中间产品和劳务两种。前者是指由最终消费者购买并使用的产品和劳务,如各种日用消费品、耐用消费品、金融、保险、旅游等;后者是指作为生产其他产品和劳务的投入而并非由最终消费者购买的产品和劳务,如生产汽车的轮胎、生产面包的小麦等。在计算 GDP 时,只计算最终产品与劳务的价值,而不能重复计算中间产品与劳务的价值。

在实际过程中,通常利用增值法来避免重复计算的问题。即在商品生产的每一过程,只有价值增值的那一部分才被计入 GDP。下面以消费品中面包的生产为例来说明。

如表 1-1 所示,在生产面包的四个过程中,小麦、面粉和烘烤的生面都是中间产品,面包则是最终产品,因此只有面包的价值才能计入 GDP,而小麦、面粉和生面的价值则都不能计入。此例中,面包的产值为 20 万元,用增值法计算的总和也是 20 万元,两者相等。这是因为面粉厂所生产的面粉价值,要减去购买麦子的成本,才是计入 GDP 的价值增值部分;同理,生面的价值也要减去购买面粉的成本,才能计入 GDP。如此计算下去,面包的价值恰好等于每一过程的价值增值之和。

表 1-1 面包增值计算表 单位:万元

生产阶段	产品价值 (1)	中间产品成本 (2)	增值 (3) = (1) - (2)
小麦	5	0	5
面粉	8	5	3
烘烤的生面	15	8	7
面包	20	15	5
合计	48	28	20

2. 市场价格

GDP 以市场价格来衡量最终产品和劳务的价值。这就产生两个问题:第一,GDP 仅指由市场活动产生的价值。而家务劳动、自给自足等非市场活动,由于其最终产品和劳务不进入市场销售,也没有价格,因此一般不会计入 GDP。第二,由于价格是变动的,因此 GDP 不仅受最终产品与劳务数量的影响,还要受价格水平变动的影响。

3. 本期产出

GDP 由一定时期内所生产的产出价值构成。关于本期产出,也要注意两点:第一,GDP 是本期所生产而不是所卖掉的最终产品与劳务价值。若企业在某年生产了 50 万元产品却只卖掉 30 万元,剩下的 20 万元作为存货投资也应计入 GDP。反之,如果企业当年生产了 50 万元产品却卖掉了 60 万元,则计入 GDP 的仍为 50 万元,另外 10 万元只是减少了企业的存货而已。第二,GDP 是一个流量而非存量的概念。例如,在以前年度建成而在本年卖出的房屋就不能计入本年的 GDP,因为该房屋的价值已经在建成的当年计算过了。但经纪人在此房屋买卖过程中提取的费用,由于是经纪人的本期劳务所得,因此可计入 GDP。

二、国内生产总值的核算方法

在西方国家的核算体系中,可用支出法、收入法、生产法来核算国内生产总值,不过最常用的还是前两种。下面对前两种分别予以介绍。

1. 支出法

支出法又称最终产品法,是指通过核算整个社会在一定时期内购买最终产品与劳务的总支出来计算 GDP 的方法。一个社会对最终产品和劳务

的支出包括四个部分:消费、投资、政府购买和净出口。因此,按照支出法,GDP 总值由以下几部分组成:

(1) 消费支出

个人消费支出(C)是指一定时期内居民购买的产品与劳务的全部支出。其支出项目可分为三类:第一,购买耐用消费品的支出。所谓耐用消费品,一般是指在较长时间内消费的物品,如洗衣机、电冰箱、空调、汽车等。第二,购买非耐用消费品的支出。所谓非耐用消费品,一般是指短期内消耗完的产品,如食品、饮料、服装等。第三,购买劳务的支出,如理发、医疗、咨询等。消费支出中不包括居民购买新住房的支出,这一项包括在投资支出内。

(2) 投资支出

投资支出(I),即私人国内总投资,它是指在一定时期内更换资本资产的支出。投资包括固定资产投资和存货投资两大类。固定资产投资是指新房产、新设备、新商业用房以及新住宅的增加。存货投资则是指经济中存货价值的变动,它等于本期末存货与上期末存货的价值之差,即:

$$(I.1) \quad \text{本期存货投资} = \text{本期末存货} - \text{上期末存货}$$

因此,存货投资可为正值,也可为负值。存货投资为正,说明本期生产的产品多于本期出售的产品,企业所持的存货增加;存货投资为负,说明本期生产的产品少于本期出售的产品,这时本期销售的一部分产品是前期生产的存货,因此企业的存货减少。

由投资的定义不难看出,它是一个流量而非存量的概念。资本存量是经济社会在某一时刻上的资本总量,而投资则是一定时期内增加到资本存量中的资本流量。一定时期内经济中的投资总额叫总投资。总投资分为两部分:重置投资和净投资。重置投资用于资本消耗的补偿,也叫资本折旧。净投资等于总投资减去折旧,即净投资增加资本存量,而重置投资则使原有的资本存量保持不变。总投资、净投资、资本存量的关系如下:

$$\text{本期末资本存量} = \text{上期末资本存量} + \text{本期总投资} - \text{本期资本折旧}$$

$$\text{本期净投资} = \text{本期总投资} - \text{本期资本折旧}$$

$$\text{本期净投资} = \text{本期末资本存量} - \text{上期末资本存量}$$

作为国内生产总值的一部分是总投资而不是净投资,因为所有用于投

资的最终产品都是国民产出的一部分,而不论这些投资品属于重置投资还是净投资。

(3) 政府购买支出

政府购买(G)是指各级政府购买产品与劳务的支出。这一项支出包括提供国防、设立法院、建设道路等方面的费用,但不包括转移支付。因为转移支付只是简单地把收入从一些人或组织转移到另一些人或组织,并没有发生相应的物品或劳务的交换。即转移支付是政府不以取得产品与劳务为目的的支出,因此不包括在政府购买之内。

(4) 净出口

产品与劳务的净出口是指出口额(X)与进口额(M)的差值。进口应从本国购买中减去,因为它表示收入流到国外,同时也不是用于购买本国产品的支出;出口则应加入本国购买之中,因为它表示收入从国外流入,是用于购买本国产品的支出。所以,净出口应计入总支出,它可能为正值,也可能为负值。

综上所述,用支出法核算 GDP 的公式可写为:

$$GDP = C + I + G + (X - M) \quad (1.1)$$

表 1-2 以美国 1996 年第二季度的 GDP 和需求构成情况来说明支出法的应用。

表 1-2 1996 年美国第二季度的 GDP 与需求的组成部分

项目	数额(单位:10 亿美元)	在 GDP 中的百分比(%)
个人消费支出	5 139	68.1
私人国内总投资	1 096	14.5
政府采购商品与劳务	1 409	18.7
商品与劳务的净出口	- 99	-1.3
国内生产总值	7 545	100

资料来源:多恩布什、费希尔、斯塔兹:《宏观经济学》(第七版),北京:中国人民大学出版社 2000 年版,第 22 页。

2. 收入法

收入法又称生产要素法,它从要素收入或企业生产成本的角度来核算国内生产总值。任何产品和劳务通过市场交易所获得的收入,必定会通过厂商分配到各种生产要素中去。例如,支付给所雇劳动力的工资、支付给