

# 高级宏观经济学教程

上册

梁小民 著

北京大学出版社

AOJI HONGGUAN  
JINGJIXUE JIAOCHENG



# 高级宏观经济学教程

(上 册)

梁小民 著



北京大学出版社



2 018 6992 3

# 高级宏观经济学教程

(下 册)

梁小民 著



北京大学出版社

新登字(京)159号

高级宏观经济学教程（上、下册）

梁小民 著

责任编辑：符丹

\*

北京大学出版社出版发行

（北京大学校内）

国防科工委印刷厂 印刷

新华书店经售

\*

850×1168毫米 32开本 28印张 690千字

1993年3月第一版 1993年3月第一次印刷

印数：0001—4000册

ISBN 7-301-01781-2/F·146

定价：17.20元

## 内 容 简 介

本书系统地反映了当代宏观经济学的最新进展。全书共五编，依次介绍了宏观经济学的基本知识、总需求分析、总供给分析、宏观经济的主要问题以及开放经济中的宏观经济学等内容。本书结构新颖合理，内容丰富，论述问题全面，具有较高的学术价值，可供高校经济学专业本科生、研究生及教师研究人员参考使用。

## 序 言

从 1985 年起，我为经济系西方经济学专业的研究生开设“高级宏观经济学”课程。从 1987 年起，这门课被作为北京大学经济学院各系各专业研究生的共同必修课。呈现在读者面前的这本“高级宏观经济学教程”正是这五年间教学与研究工作的结晶。

我之所以写这样一本书，主要是出于两种考虑。第一，这些年来我国编写出版了不少西方经济学教科书，其层次相当于国外初级程度，或介于初级与中级程度之间。在开始学习研究西方经济学时，这类书当然是必要的。但随着对西方经济学研究的深入，许多人感到还需要高级程度的教科书，其程度应该达到国外经济系硕士研究生所学习的水平。我的这本书正是想为学过初级宏观经济学的大学生、研究生、科研人员、教师和实际工作者深入研究宏观经济学提供一本程度较高的参考书。第二，国外有许多高级宏观经济学教科书，我在教学与研究中也读了其中的一些。应该说有些书写得相当好，例如，我在教学中指导研究生阅读的麻省理工学院教授 R. 多恩布施 (R. Dornbusch) 与 S. 费希尔 (S. Fischer) 合写的《宏观经济学》就是一本优秀的高级宏观经济学教科书，被国外许多著名学校采用作为研究生的教材 (根据国外评价，麻省理工学院的宏观经济学课程在美国名列第一<sup>①</sup>)。但是，我在教学中感到，自己编写这种教科书比直接翻译更适合于我国读者的需要。或者也可以说，尽管翻译出版一些高水平的国外教科书是必要的，但这并不能代替中国人自己编写教科书。因为自己编写的教科书有这样几个外国人编写的教科书无法代替的优点：其

---

<sup>①</sup> 参见黄谷：《美国经济学界》，载《经济文献信息》杂志，1990 年第 5 期。

一，在章节安排、逻辑结构、语言表述方面更适合中国人的阅读习惯；其二，在内容上可以综合各家之长，并根据中国读者的需要作到有的放矢；其三，根据中国的实际情况作出适当的分析与评论。

基于以上考虑我为这本书定的指标是：程度高、内容新、适于中国读者阅读。程度高是指全书的水平相当于国外经济系的硕士研究生课程水平；内容新是指要尽力反映出宏观经济学的最新发展与成果；适于中国读者是指根据中国读者的现有水平选择内容，并适当联系中国的实际。

我正是根据以上三个指标来安排全书的体系与内容。

首先来谈谈全书的体系。外国人编写的宏观经济学体系并不相同。第一种是以凯恩斯主义宏观经济学体系为中心来展开的，例如，前面提到的 R. 多恩布施与 S. 费希尔的《宏观经济学》，在中国读者中影响较广的 E. 夏皮罗 (E. Shapiro) 的《宏观经济分析》(中国社会科学出版社组织翻译出版了该书的第四版)，都属于这种体系。第二种是以介绍各主要经济学流派的宏观经济学为中心来展开的，例如，R. 弗洛伊 (R. Froyen) 编写的《宏观经济学：理论与政策》(麦克米兰出版公司，1983 年)，就是这种体系。我国学者高鸿业、吴易风编写的《现代西方经济学》(上册，经济科学出版社，1988 年) 也采用这种体系来介绍宏观经济学。第三种是根据自己所属的经济学流派观点来编写宏观经济学，例如，R. 巴罗 (R. Barro) 的《宏观经济学》(约翰·威利父子公司，1990 年第 3 版) 反映了新凯恩斯主义的观点，R. 霍尔 (R. Hall) 和 J. 泰勒 (J. Taylor) 的《宏观经济学：理论、运行和政策》(中国经济出版社组织翻译了该书的 1986 年版) 则更多地反映了理性预期学派观点。当然，也还有其他体系。我所采用的基本是第一种体系。因为从现在来看由凯恩斯主义发展而来的现代宏观经济学体系仍然占主导地位，而且，经过许多经济学家的努力已经相当

成熟。在国外的教科书中绝大多数属于这一体系。这样，采用这一体系也有助于读者进一步阅读国外这一方面的著作。但我又不完全拘泥于这一体系，而是在以这一体系为主线的同时，兼顾了其他流派的观点，以便读者对这一领域有更为广泛的了解，并反映最新进展。

根据以上的看法，我把本书分为五篇。第一编“导论”介绍有关宏观经济学的基本预备性知识，包括现代宏观经济学形成与发展的历史，现代宏观经济学的概况，以及国民收入核算理论。第二编“总需求分析”是以  $IS-LM$  模型为中心展开凯恩斯主义的宏观经济理论与政策分析。第三编“总供给分析”是研究决定国民收入的另一个重要因素——总供给，并把总需求与总供给结合在一起说明国民收入与价格水平的决定。第四编“宏观经济的主要问题”是运用国民收入决定理论分析失业、通货膨胀、经济周期与经济增长这些宏观经济中的重大问题。第五编“开放经济中的宏观经济学”是研究开放经济条件下的各种宏观经济问题。最后的“结束语”作为全书的总结，是从整体上对宏观经济学进行评论，并说明西方宏观经济学对我国经济的不适用性及其可借鉴之处。

其次，谈谈本书的内容。为了使本书达到国外硕士研究生课程的水平，我把 R. 多恩布施与 S. 费希尔 1987 年第 4 版《宏观经济学》作为主要参考书。我所介绍的内容的深度与广度要达到并超过它的水平。但我的书决不是《宏观经济学》的中文编译本，而是要突出自己的特点。不仅全书的体系安排与它不同，而且，在内容上有自己的特点。这就表现在：第一，使本书的内容更适合中国读者的需要。这就要增加许多国外教科书不写或写得很少的内容，同时，对国外教科书讲得较为简单的内容作较为详细的说明。第二，综合国外各种教科书的优点，同时又反映国外宏观经济学研究的最新成果。第三，运用马克思主义对宏观经济学进行



评论、分析，并联系中国的实际。总之，我力图使这本书内容丰富、层次较高，有中国的特色，以便使读者对西方宏观经济学的内容有较全面而深入的了解，从而成为读者学习、教学和研究工作的一本有用的参考书。

最后，我谈谈参考书问题。在阅读本书之前，读者可以先读几本初级宏观经济学教科书作为准备。最简单的入门性读物可以看 我写的《西方经济学入门》中的第 9 -14 章（中国计划出版社，1989 年）。较为高深一点的最好看陈志标著的《宏观经济学》（上海人民出版社，1989 年）。也可以读外国人写的，例如，萨缪尔森与诺德豪斯编写的《经济学》中宏观经济学部分（第 12 版，中文本将由商务印书馆出版）。在阅读本书时，也可以有选择地读一、二本外国人写的高级宏观经济学教科书，例如，R. 霍尔与 J. 泰勒的《宏观经济学：理论、运行和政策》（中国经济出版社，1988 年）。如果英文较好，最好读一本英文版的书，例如，前面多次提到的 R. 多恩布施与 S. 费希尔的《宏观经济学》，或者 R. 戈登的《宏观经济学》（1987 年第 4 版）。但在选择时一定要选 80 年代以后出的书，因为 80 年代前的书体系与内容都较为陈旧。本书对中国的宏观经济问题谈得不多，读者如在这方面有兴趣也可以选一、二本较好的读物。我认为在这方面最值得一读的是由樊纲主笔的《公有制宏观经济理论大纲》（上海三联书店，1990 年）。本书尽管较为详尽，但也是起一个引导的作用，读者可以在此基础深入研究其中的某些问题。为了给读者进一步钻研提供方便，我在每章后面都列出了主要参考书目，并加以简单说明。在选择这些参考书时，我有意识地尽量多选有中文译本的书，以便读者查找方便。

这本《高级宏观经济学教程》从准备到成书经过了 5 年多的时间，其间曾三易其稿，现在呈现给读者的是第三稿。尽管自己作了不少努力，但写完之后再读一遍，也并不觉得十分理想。但

我还是愿意把它拿出来，希望读者从中有所收获，也真诚地愿意听到批评指正。

我当研究生时师从北京大学杜度教授、胡代光教授、范家骥教授和厉以宁教授，在工作之后除了得到这些老师的帮助指正之外，还得到中国人民大学高鸿业教授、华中理工大学张培刚教授、华东化工学院宋承先教授等师长的指教。本书写作过程中得到北大出版社副总编彭松建教授，以及符丹、陈义同志的帮助。我的妻子儿女在事业与生活上给予了我无微不至的关怀。这本书也有他们的辛劳与心血。在这本书问世时，我想向一切帮助过我的人表示深深的谢意。

梁小民

# 目 录

(上 册)

序 言	( 1 )
第一编 导 论	( 1 )
第一章 现代宏观经济学的形成与发展	( 2 )
第一节 古典经济学的宏观经济理论	( 3 )
第二节 新古典经济学及 30 年代前的 宏观经济理论	( 13 )
第三节 现代宏观经济学的建立与发展	( 30 )
第二章 现代宏观经济学概况	( 47 )
第一节 宏观经济学的根本问题与概念	( 47 )
第二节 宏观经济理论	( 58 )
第三节 宏观经济政策	( 62 )
第四节 宏观经济计量模型	( 78 )
第五节 宏观经济学方法论	( 86 )
第三章 国民收入核算理论与方法	( 95 )
第一节 国民经济的收入流量循环模型	( 96 )
第二节 国民生产总值及其核算	( 101 )
第三节 国民收入核算中的其他总量	( 109 )
第四节 国民收入核算中总需求与总供给的 恒等关系	( 114 )

第五节	国民经济核算体系中的几个问题	(117)
<b>第二编</b>	<b>总需求分析</b>	(125)
第四章	简单的国民收入决定模型	(126)
第一节	两部门经济中国民收入的决定	(126)
第二节	乘数理论	(139)
第三节	财政政策对均衡国民收入的影响	(144)
第四节	财政政策与财政预算	(151)
第五章	产品市场与货币市场的均衡： IS-LM 模型	(158)
第一节	IS-LM 模型在宏观经济学中的地位	(158)
第二节	IS 曲线与产品市场的均衡	(163)
第三节	LM 曲线与货币市场的均衡	(174)
第四节	IS-LM 模型：产品市场与货币 市场的均衡	(184)
第六章	财政政策与货币政策：IS-LM 模型的运用	(191)
第一节	货币政策的效应与机制	(191)
第二节	财政政策的效应和机制	(196)
第三节	宏观经济政策的选择与配合	(204)
第七章	消费函数理论	(209)
第一节	凯恩斯的消费函数理论： 绝对收入假说	(209)
第二节	生命周期假说	(219)
第三节	持久收入假说	(231)
第四节	相对收入假说	(242)
第五节	影响消费的其他因素	(249)
第六节	消费与 IS-LM 模型	(256)
第八章	投资理论	(262)

第一节	企业固定资产投资（一）：合意资本 存量的确定·····	(264)
第二节	企业固定资产投资（二）：投资率的决定·····	(276)
第三节	企业固定资产投资（三）：加速原理·····	(281)
第四节	企业固定资产投资（四）：实际投资决策·····	(288)
第五节	住房投资·····	(291)
第六节	存货投资·····	(398)
第九章	货币需求理论·····	(307)
第一节	货币的基本知识·····	(307)
第二节	交易动机的货币需求模型·····	(313)
第三节	预防动机的货币需求模型·····	(321)
第四节	投机动机的货币需求模型·····	(325)
第五节	货币需求理论的经验研究·····	(332)
第六节	货币流通速度与货币需求模型·····	(338)
第七节	现代货币主义的货币需求模型·····	(345)
第十章	货币供给理论与货币政策·····	(349)
第一节	货币供给的基本知识·····	(349)
第二节	货币乘数与货币供给机制·····	(354)
第三节	货币供给函数·····	(360)
第四节	货币市场均衡与货币政策分析·····	(372)
第十一章	需求管理政策的实践与问题·····	(387)
第一节	需求管理政策的实践： 从 30 年代到当代·····	(387)
第二节	需求管理政策运用中的各种问题·····	(403)
第三节	关于需求管理政策的争论·····	(416)

# 目 录

(下 册)

<b>第三编 总供给分析</b> .....	(435)
<b>第十二章 总需求-总供给模型：概述</b> .....	(436)
<b>第一节 总需求曲线</b> .....	(437)
<b>第二节 总供给曲线</b> .....	(446)
<b>第三节 总需求-总供给模型与需求管理政策         分析</b> .....	(451)
<b>第十三章 总供给模型</b> .....	(463)
<b>第一节 新古典总供给模型</b> .....	(463)
<b>第二节 凯恩斯主义总供给模型</b> .....	(473)
<b>第三节 现代凯恩斯主义总供给模型</b> .....	(482)
<b>第四节 理性预期学派的总供给模型</b> .....	(495)
<b>第十四章 总需求-总供给模型与动态调整</b> .....	(504)
<b>第一节 现代凯恩斯主义总需求-总供给模型</b> .....	(504)
<b>第二节 理性预期学派的总需求-总供给模型</b> .....	(515)
<b>第三节 供给学派的总需求-总供给模型</b> .....	(520)
<b>第四编 主要宏观经济问题</b> .....	(525)
<b>第十五章 通货膨胀理论</b> .....	(526)
<b>第一节 通货膨胀：定义、衡量与类型</b> .....	(526)
<b>第二节 需求拉上与成本推动通货膨胀理论</b> .....	(536)

第三节	结构性通货膨胀理论·····	(546)
第四节	货币数量与通货膨胀·····	(552)
第五节	预期理论与通货膨胀·····	(559)
第六节	财政赤字与通货膨胀·····	(565)
第七节	通货膨胀的数济效应·····	(571)
第十六章	失业与通货膨胀：菲利浦斯曲线·····	(583)
第一节	失业概论·····	(583)
第二节	菲利浦斯曲线 (I)：原始菲利浦斯 曲线·····	(591)
第三节	菲利浦斯曲线 (II)：附加预期的 菲利浦斯曲线·····	(597)
第四节	菲利浦斯曲线 (III)：理性预期的 菲利浦斯曲线·····	(604)
第五节	菲利浦斯曲线 (IV)：新凯恩斯 主义的解释·····	(608)
第六节	滞胀·····	(611)
第七节	对付失业与通货膨胀的政策·····	(617)
第十七章	经济周期理论·····	(631)
第一节	历史的回顾：凯恩斯主义之前的 经济周期理论研究·····	(632)
第二节	卡尔多的经济周期理论·····	(646)
第三节	乘数-加速模型 (I)：哈罗德的分析·····	(655)
第四节	乘数-加速模型 (II)：萨缪尔森的 分析·····	(660)
第五节	乘数-加速模型 (III)：希克斯的分析·····	(669)
第六节	货币主义的经济周期理论·····	(681)
第七节	理性预期的经济周期理论·····	(686)
第八节	其他经济周期理论·····	(690)

第十八章	经济增长理论	(698)
第一节	经济增长：含义、衡量与来源	(698)
第二节	哈罗德-多马经济增长模型	(704)
第三节	新古典经济增长模型	(712)
第四节	新剑桥经济增长模型	(718)
第五节	资本积累与经济增长	(722)
第六节	技术进步与经济增长	(729)
第七节	经济增长因素分析	(736)
<b>第五编</b>	<b>开放经济下的宏观经济运行与调节</b>	<b>(745)</b>
第十九章	开放经济的基本知识	(746)
第一节	开放程度及其对经济的影响	(746)
第二节	国际收支	(749)
第三节	汇率理论	(754)
第二十章	固定汇率制下的宏观经济运行与调节	(764)
第一节	开放经济中的 $IS-LM$ 模型	(764)
第二节	内在均衡与外在均衡的政策调整	(773)
第三节	开放经济中的总需求-总供给模型	(780)
第四节	资本流动与经济调节	(788)
第二十一章	浮动汇率制下的宏观经济运行与调节	(800)
第一节	汇率与国民收入均衡	(800)
第二节	完全资本流动与浮动汇率下的经济调节：蒙代尔-弗莱明模型	(805)
第三节	浮动汇率、货币与价格	(814)
第四节	利率差别与汇率预期	(819)
第五节	汇率变动与贸易调整	(824)
第六节	汇率波动与各国经济的相互依赖性	(828)



<b>结束语</b> .....	(836)
一 微观经济学与宏观经济学的关系.....	(836)
二 对宏观经济学的几点评论.....	(848)
三 宏观经济学与战后西方经济的发展.....	(858)
四 宏观经济学与我国的经济建设.....	(865)