



现代远程教育系列规划教材
XIANDAI YUANCHENG JIAOYU XILIE GUIHUA JIAOCAI

宏观经济学

HONGGUAN JINGJIXUE

王文玉 王霄琼 沈 琼 编著



郑州大学出版社

宏观经济学

王文玉 王霄琼 沈 琼编著

郑州大学出版社

图书在版编目(CIP)数据

宏观经济学/王文玉,王霄琼,沈琼编著. —郑州:郑州大学出版社,
2010.10

(现代远程教育系列规划教材)

ISBN 978—7—5645—0286—7

I. ①宏… II. ①王… ②王… ③沈… III. ①宏观经济学—远距离
教育—教材 IV. ①F015

中国版本图书馆 CIP 数据核字 (2010) 第 194965 号

郑州大学出版社出版发行

郑州市大学路 40 号

出版人:王 锋

全国新华书店经销

郑州文华印务有限公司印制

开本:787 mm×1 092 mm

印张:11.5

字数:275 千字

版次:2010 年 10 月第 1 版

邮政编码:450052

发行部电话:0371—66966070

1/16

印次:2010 年 10 月第 1 次印刷

书号:ISBN 978—7—5645—0286—7

定价:19.80 元

本书如有印装质量问题,由本社负责调换



1

导论

- 1.1 宏观经济学的研究对象
- 1.2 经济波动
- 1.3 宏观经济学简史
 - 1.3.1 萨伊定律
 - 1.3.2 凯恩斯革命
 - 1.3.3 宏观经济学的黄金时代及其终结

2

衡量宏观经济

- 2.1 宏观经济流量循环图
 - 2.1.1 流量与存量
 - 2.1.2 简单经济
 - 2.1.3 引入政府部门
 - 2.1.4 引入对外贸易部门
- 2.2 衡量总产出
 - 2.2.1 国内生产总值
 - 2.2.2 用支出法计算 GDP
 - 2.2.3 用收入法计算 GDP
 - 2.2.4 与 GDP 相关的总量
 - 2.2.5 恒等式
 - 2.2.6 GDP 的缺陷
- 2.3 衡量通货膨胀
- 2.4 衡量失业

3

简单收入决定模型

- 3.1 收入决定理论概述

3.2 简单收入决定模型

3.2.1 总需求决定均衡产出

3.2.2 意愿总支出与均衡产出

3.3 简单经济体中的均衡收入

3.3.1 简单经济体中总支出的构成

3.3.2 消费函数

3.3.3 自主投资

3.3.4 AE 函数和均衡产出

3.4 注入、漏出和均衡产出

3.4.1 均衡收入条件

3.4.2 储蓄函数

3.5 乘数

3.5.1 乘数的概念

3.5.2 乘数原理

3.6 政府部门

3.6.1 引入政府部门后的总支出

3.6.2 均衡收入

3.7 与政府有关的乘数

3.7.1 政府购买支出乘数

3.7.2 转移支付乘数

3.7.3 税的变动对均衡收入的影响

3.8 预算

3.8.1 预算盈余

3.8.2 政府购买支出对预算盈余的影响

3.8.3 平衡预算乘数

4

$IS-LM$ 模型

4.1 IS 曲线

4.1.1 投资函数

4.1.2 IS 曲线的推导

4.1.3 IS 曲线的斜率

4.1.4 IS 曲线的移动

4.1.5 偏离 IS 曲线的点

4.2 货币市场的均衡

4.2.1 货币的概念

4.2.2 货币的计量

- 4.2.3 货币需求
- 4.2.4 货币供给和均衡利率

4.3 *LM* 曲线

- 4.3.1 *LM* 曲线的定义和推导
- 4.3.2 *LM* 曲线的斜率
- 4.3.3 *LM* 曲线的位置
- 4.3.4 偏离 *LM* 曲线的点

4.4 商品和资产市场的同时均衡

- 4.4.1 均衡收入和利率的同时决定
- 4.4.2 均衡收入和利率的变动
- 4.4.3 两个市场的失衡及其调整

5

财政政策和货币政策

5.1 财政政策

- 5.1.1 财政政策工具
- 5.1.2 财政政策的一般效果
- 5.1.3 挤出效应
- 5.1.4 两种极端情况
- 5.1.5 自动稳定器
- 5.1.6 相机抉择和功能财政
- 5.1.7 赤字和国债

5.2 货币政策

- 5.2.1 货币政策的一般效果
- 5.2.2 两个极端情况
- 5.2.3 货币政策工具
- 5.2.4 财政政策和货币政策的混合使用
- 5.2.5 政策实践中的一些问题

6

贸易与资本流动

6.1 贸易与均衡产出

- 6.1.1 开放经济下的 *AE* 函数
- 6.1.2 均衡产出
- 6.1.3 回弹效应

6.2 资本流动

- 6.2.1 国际收支余额

6.2.2 *BP* 曲线

6.2.3 内部平衡与外部平衡的协调

6.3 资本完全自由流动

6.3.1 资本完全自由流动与 *BP* 曲线

6.3.2 汇率制度

6.3.3 资本完全自由流动和固定汇率下的货币政策和
财政政策

6.3.4 资本完全自由流动和浮动汇率下的货币政策和
财政政策

7

AD-AS 模型

7.1 总需求

7.1.1 总需求曲线的推导

7.1.2 *AD* 曲线的斜率

7.1.3 *AD* 曲线的移动

7.2 总供给

7.2.1 总供给概述

7.2.2 古典总供给曲线

7.2.3 极端的凯恩斯总供给曲线

7.2.4 现代凯恩斯主义总供给曲线

7.2.5 理性预期学派的总供给曲线

7.2.6 时间与总供给曲线

7.2.7 总供给的移动

7.3 均衡产出和价格水平

7.3.1 均衡产出和价格水平的决定

7.3.2 均衡产出和价格水平的变动

8

失业、通胀和菲利普斯曲线

8.1 失业

8.1.1 失业的类型

8.1.2 自然失业率

8.1.3 奥肯定律

8.2 通货膨胀

8.2.1 通货膨胀的后果

8.2.2 通货膨胀的成因

8.2.3 货币与通货膨胀

8.3 菲利普斯曲线

8.3.1 菲利普斯曲线的由来

8.3.2 菲利普斯曲线的理论推导

8.3.3 菲利普斯曲线的移动和变异

9

增长理论

9.1 增长理论概述

9.2 增长核算

9.2.1 增长核算的理论

9.2.2 经验分析

9.3 哈罗德 - 多马增长模型

9.3.1 增长模型概述

9.3.2 哈罗德 - 多马增长模型的基本假设

9.3.3 有保证增长率

9.3.4 有保证增长率的不稳定性

9.3.5 自然增长率

9.4 新古典增长模型

9.4.1 新古典模型的关键假设

9.4.2 均衡人均资本量

9.4.3 均衡人均产出和总产出增长率

9.4.4 储蓄率的变动

9.4.5 增长中的黄金律

9.4.6 折旧

9.4.7 技术进步

参考文献



导论

1.1 宏观经济学的研究对象

经济学研究分工合作方式下稀缺资源的有效利用。西方主流经济学的理论体系由微观经济学和宏观经济学组成。

微观经济学着重分析组成经济的个体——消费者、生产者、劳动者、地主、资本家和企业家——的行为。它试图通过分析个体行为来得出经济规律,并用这些规律解释经济现象。微观经济学的主要任务是理解价格机制的运行原理,说明在什么条件下价格机制即市场能够有效配置资源,在什么条件下市场不能有效配置资源从而需要政府干涉。微观经济学的主要内容有:消费者行为理论、厂商或生产者行为理论、产品价格理论、要素市场理论和微观经济政策等。

宏观经济学把整个经济作为一个总体加以研究。它研究描述整个经济运行态势的总量及其关系。所以,宏观经济学也称总体经济学,属于总量分析。宏观经济的主要任务是解释和预测宏观经济的运行,解释长期增长趋势和短期波动,从而为宏观经济政策提供依据。宏观经济学的主要内容有:国民收入核算、短期收入决定理论即经济周期理论、经济增长理论和宏观经济政策等。宏观经济学以微观经济学为基础,因为宏观经济现象最终源于个人行为;宏观经济总量是描述个人行为或单个市场行为的个量的加总。

1.2 经济波动

如图 1-1 所示,和其他主要国家的经济一样,美国经济的长期走势是增长,但也经常经历短期波动,而且有效短期波动十分剧烈,比如 1920—1921 年的衰退和 1929—1933 年的大萧条。

经济学家把经济活动的水平的交替上升和下降称做商业周期或经济周期。如图 1-2 所示,一个经济周期有四个阶段:繁荣、衰退、萧条和复苏。繁荣是经济活动水平的一个峰值;从这个峰值之后,经济活动的水平开始下降,称经济衰退;当经济活动的水平降低到一个最低点或谷底时,称做萧条;之后,经济活动的水平上升,称做复苏。另外,按照美

国国家经济研究局(National Bureau of Economic Research) 的定义,衰退是指经济活动连续六个月以上下降,萧条则是指持续多年且失业率居高不下的严重衰退。

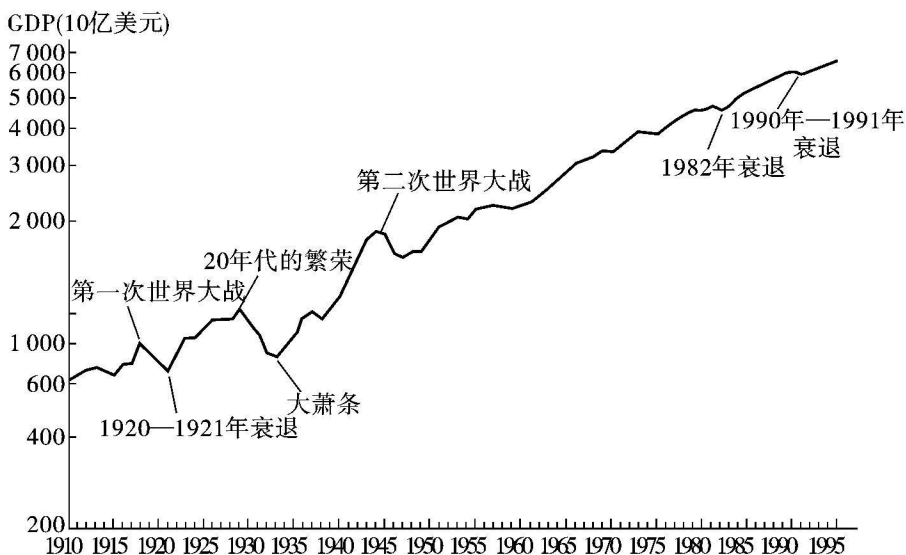


图 1-1 1910—1995 年的美国经济走势

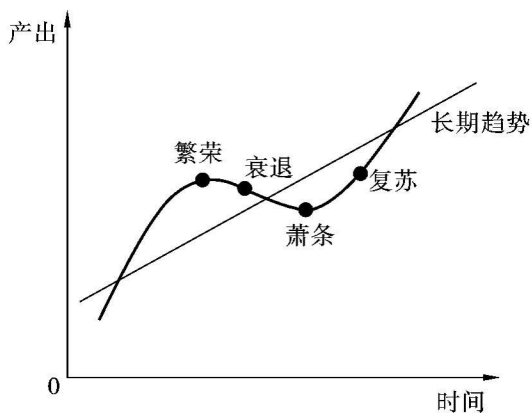


图 1-2 经济周期

在经济周期的研究方面,经济学家们付出很多努力。著名的研究成果有:

法国经济学家朱格拉在《论法国、英国和美国的商业危机及其发生周期》中研究了较长经济周期,并根据生产、就业人数和物价等指标,确定了经济中一个周期的平均长度为9~10年,又称朱格拉周期。

1923年,英国经济学家J. 基钦在《经济因素的周期与趋势》中研究了1890—1922年英国与美国数据,识别了长度3~4年的短周期,又称基钦周期。

1925年,俄国经济学家N. 康德拉季耶夫在《经济生活中的长周期》中研究了美国、英

国、法国等国家的数据,提出了平均长度为 54 年的长周期,又称康德拉季耶夫周期。

1930 年,美国经济学家 S. 库兹涅茨在《生产和价格的长期运行》中指出了一种与建筑业相关的经济周期,又称库兹涅茨周期或建筑周期,其平均长度为 20 年。



知识链接

美国的经济周期

美国国家经济研究局的专家们研究了 1854 年以来美国的经济周期。自那以来,美国经济经历了 30 多次扩张和收缩。没有两个相同的周期。最长的周期是从 1961 年到 1969 年,长达 106 个月,最短的周期则只有 10 个月,发生在 1919 年和 1920 年。最长的收缩期发生在 1873 年到 1879 年,持续了 65 个月,而最短的收缩期发生在 1980 年,仅仅持续 6 个月。

1933 年以来,美国经济经历了大约 10 个周期。在这个时期,和平时期的扩张平均长度约为 3 年,收缩期约为 1 年。形成对照的是,在 1933 年以前的 10 个周期中,扩张期约为两年,收缩期也约为两年稍短一些。1933 年以来,不仅衰退期变短了,而且也不那么严重了。早期的经济周期往往是萧条,即严重的衰退,而第二次世界大战之后几乎没有发生萧条。一个明显的变化是,扩张期变长了,而收缩期变短了。然而,整个周期的平均长度还是大约 4 年。

1.3 宏观经济学简史

1.3.1 萨伊定律

古典宏观经济学可以概括为萨伊定律,即供给创造它自己的需求。萨伊定律的意思是,市场经济中不会出现普遍的生产过剩。萨伊在 1803 年出版的《政治经济学概论》中说“值得肯定的是,一种产品一旦被生产出来,它立即就它的最大价值为其他产品提供了一个市场,当生产者生产出来一种产品,他非常急切地想把它立即卖掉,否则它的价值将会在他的手里消失。如果他卖掉它得到了货币,他会同样急切地想把货币花掉,因为货币的价值也不是长久的。但是花掉货币的唯一方式就是用它购买某种产品。因此,仅是一种产品的生产就会立即为其他产品打开销路。……”^①

詹姆斯·穆勒在 1808 年更精确地描述了这一思想“如果一个国家的购买力可以以它的年产出来精确度量……其年产出提高得越多,这一行为同时也可以更多地拓展整个国家的市场、购买力和实际的购买数量。”

^① 斯坦利·L·布鲁:《经济思想史》,机械工业出版社 2003 年第 6 版,第 99 页。

1.3.2 凯恩斯革命

1936年,凯恩斯的《就业、利息和货币通论》(以下简称《通论》)标志着宏观经济学的诞生。《通论》的背景是1929年开始的波及整个世界的大萧条和英国长期以来失业率居高不下。大萧条不仅是一场经济灾难,更是研究经济周期的宏观经济学家们的失败。当时的经济学家无法解释大萧条的深度和长度。罗斯福政府的新政所包含的经济政策依据的是本能,而不是经济理论。《通论》不仅从理论上解释了大萧条为什么会发生,而且提出了政府干涉的理由。《通论》奠定了现代宏观经济学的基础。



知识链接

经济学家凯恩斯

约翰·梅纳德·凯恩斯1883年6月5日生于英格兰的剑桥,死于1946年4月21日。他的父亲约翰·内维尔·凯恩斯,是一位著名逻辑学家和政治经济学家。他的母亲是一名治安法官、市议员和剑桥的市长,对于公共事务和社会工作很感兴趣。他14岁以奖学金入伊顿公学(Eton College),主修数学,曾获托姆林奖(Tomline Prize)。毕业后,以数学及古典文学奖学金入学剑桥大学国王学院。1905年毕业,获剑桥文学硕士学位。之后又滞留剑桥一年,师从马歇尔和庇古攻读经济学。他们都承认他是天才。28岁的时候,凯恩斯成为《经济学杂志》的编辑。他同时还管理着其出版者皇家经济学会的投资,并获得了非同一般的成功。在凯恩斯的财务指导下,剑桥大学国王学院同样获得了可观的利润。通过外汇和外国商品交易,他也为自己积累了50万英镑财富。

4

凯恩斯在现实和学术生活中都是一个非常重要的人物。他是一家人寿保险公司董事会的主席,还担任其他几家公司的董事,并且是英格兰银行董事会的成员。除了作为一名金融家之外,他还是一名高级政府官员,许多学术理论著作的作者,报刊撰稿人,艺术鉴赏家和支持者以及剑桥大学的教师。他是著名的“布卢姆斯伯里团体”的重要成员。这个由杰出艺术家、作家、批评家、知识分子和演说家所组成的圈子,从1907年开始一直持续到1930年,伦纳德·伍尔芙、克莱夫·贝尔、利顿·斯特拉奇、E. M. 福斯特和其他一些名人都是其成员。

凯恩斯是第一次世界大战之后巴黎和会上英国财政部的首席代表,拥有代表财政部长发言的权力。他在巴黎的谈判经历和其强烈反对强加给德国的和平方案导致他在1919年辞去了他的官员职位,并且写作了引起争议的《凡尔赛和约的经济后果》一书。1940年他再次加入财政部,以帮助英国渡过战时的财政困难。在组织国际货币基金组织和国际复兴与发展银行的过程中以及在取得美国对英国的战后贷款的过程中他都是英国的首席谈判代表。1942年他成为一名男爵。

凯恩斯的主要著作有:《凡尔赛和约的经济后果》(1919)、《货币改革论》(1923)、《货币论》(1930)、《劝说集》(1932)、《就业、利息和货币通论》(1936)等。

1.3.3 宏观经济学的黄金时代及其终结

《通论》出版之后,宏观经济学的发展基本上都是围绕它进行的。到了20世纪50年代早期,经过一大批经济学家的努力,凯恩斯的思想与早期经济学家的思想被结合在一起,形成了所谓新古典综合(neoclassical synthesis)。其标志是1955年出版的萨缪尔森的《经济学》。从20世纪40年代到20世纪70年代是宏观经济学的黄金时代,各方面研究都取得了长足进步。希克斯(John Hicks)和汉森(Alvin Hanson)20世纪30年代和40年代初提出了 $IS-LM$ 模型;莫迪格里阿尼(Franco Modigliani)和弗里德曼(Milton Friedman)发展了消费理论;托宾(Tobin)发展了投资理论和货币需求理论;索罗(Robert Solow)在1956年建立了经济增长模型;由于国民收入核算和计算机的发展,计量经济学迅速发展,雄心勃勃的经济学家们建立了越来越大的计量经济学模型,试图更精确预测很多经济变量。

20世纪60年代,发生凯恩斯主义与弗里德曼领导的货币主义之间的论战。20世纪70年代,以卢卡斯(Robert Lucas)为首的理性预期学派对当时的主流经济学发起了强有力的攻击,引起了宏观经济学史上的另一次革命。今天,主导宏观经济研究的三派经济学家是:新古典主义者(the new classicals)、新凯恩斯主义者(the new Keynesians)和新增长理论者(the new growth theorists)。

大多数宏观经济学家有的几点共识是:①短期内,总需求变动影响产出。较高的消费者信心、更多政府支出和更快的货币增长都增加产出和就业。②有一个充分就业的潜在产出水平。它依赖于自然失业率、劳动人口规模、资本存量、技术水平和相关制度等。在中期内,经济总是趋于回到充分就业的水平。③一个经济的长期增长率取决于资本积累和技术进步。④货币政策对产出有短期影响,但在中长期内是中性的。较高的货币增长率最终导致通货膨胀。⑤财政政策在短期和长期内都影响产出。较高的财政赤字在短期内增加产出,但在长期内减少产出,因为它减少资本积累。

宏观经济学有争议的几点是:①总需求影响产出的时期即短期有多长。在一个极端,真实周期经济学家们认为经济总是处于其自然充分就业的水平,即短期十分短。在另一个极端,强调滞后效应的经济学家们认为总需求的影响可以持续很长,即短期实际上可以很长。②关于政策的作用和必要性,认为产出会迅速回到自然水平的经济学家主张严格的货币和财政政策规则,比如保持货币增长率不变和平衡预算,认为经济自身调整缓慢的经济学家则认为较为灵活的稳定政策是必要的。

不过,在这些争论背后,有一个大致相同的理论框架。本书的目的正是介绍相关基本概念和理论。

习题

1. 简述宏观经济学的研究对象。
2. 简述什么是经济周期。
3. 简述宏观经济学的发展。

2

衡量宏观经济



【学习目标】

通过本章学习,理解国内生产总值(GDP)的概念及其计算方法,了解与 GDP 相关的其他总产出指标,理解 GDP 为什么不是经济福利的准确指标,理解通货膨胀的概念和通货膨胀率的计算,理解失业的概念和失业率的计算。



【学习重点】

1. 国内生产总值的定义和计算准则
2. 国内生产总值的计算方法
3. 与国内生产总值相关的总产出指标
4. 国内生产总值的缺陷
5. 通货膨胀的定义和通货膨胀率的计算
6. 失业的定义和失业率的计算

7



【学习难点】

最终产品 收入法 国民收入核算恒等式 国内生产总值的缺陷

2.1 宏观经济流量循环图

2.1.1 流量与存量

存量是在一个时点上计算的量,用于衡量事物在这个时刻的状态。流量是在一个时间区间上计算的量,用于衡量事物在单位时间内的变化。如图 2-1 所示,在某个时刻,浴盆中水的数量是一个存量,向浴盆中注水的水流是一个流量。在某个时刻,一座粮库中小麦的数量是一个存量,每月存入或取出的小麦数量是流量;在某个时刻,一个人的账户上的存款数额是一个存量,在最近一周内他的存款增加的数额是一个流量;在某个时刻,一个经济中现有的资本量是一个存量,在过去的一年中新增的投资是一个流量。

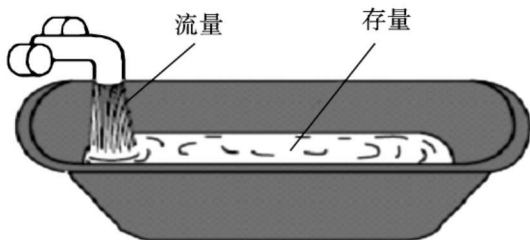


图 2-1 流量与存量

2.1.2 简单经济

一个简单经济只有两个部门:家庭和厂商。在市场经济中,家庭是消费单位 and 生产要素的所有者。厂商或企业是生产单位 and 生产要素的租用者,是以利润为最终目的的商品和服务提供者。

家庭和厂商通过要素市场和产品市场联系起来。如图 2-2 所示,通过要素市场,家庭向厂商提供生产要素并得到相应收入。图中内侧的流量代表物质生产要素从家庭流向厂商,外侧的流量代表要素收入流,对于企业来说是要素成本。通过商品市场,厂商向家庭提供商品和服务并取得销售收入。图中内侧的流量代表实物商品和服务流向家庭,外侧的流量代表家庭的支出流向厂商,成为厂商的销售收入。

一次交易由方向相反的两个流量组成:一个是实物流,另一个是货币支付流。在要素市场上,物质生产要素流向厂商,与之方向相反的货币支付流向家庭;在产品市场上,商品和服务流向家庭,与之方向相反的货币支付流向企业。所以,在下面的描述中,我们只给出支付流。

现在,我们引入金融市场。金融市场的基本功能是把家庭储蓄变成企业和消费者借款。不过,在我们的模型中,如图 2-3 所示,我们假设只有企业借款。金融市场包括银行和证券市场。通过证券市场进行融资被称做直接融资,其中,储户直接把钱借给企业。通过银行进行融资被称做间接融资,其中,储户先把钱借给银行,然后银行把钱借给企

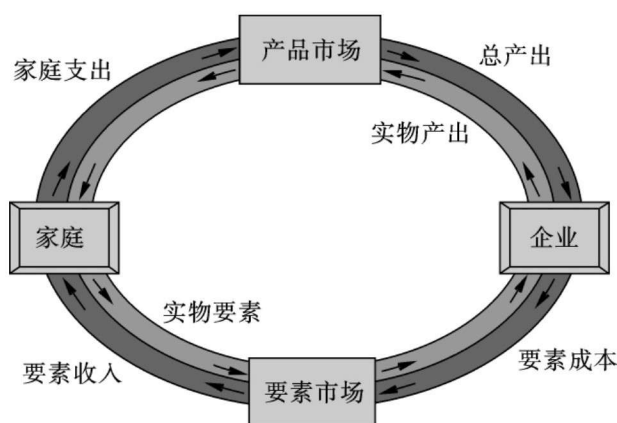


图 2-2 简单经济的流量循环图

业。企业把借来的钱用于投资(I)，即购买资本品，其中包括厂房、机械设备、材料等。如图 2-3 所示，企业的投资支出流向产品市场。这时的产品市场上也就有了资本品。

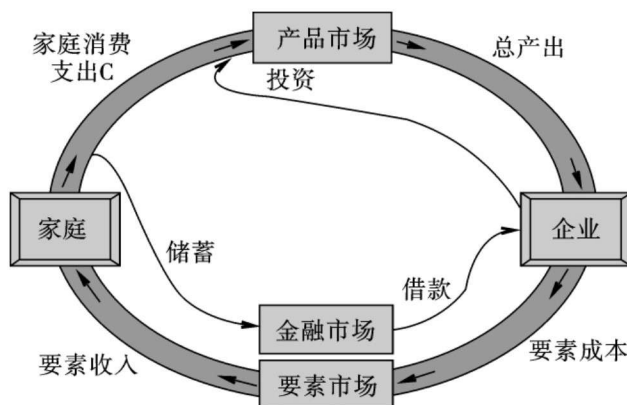


图 2-3 金融市场的作用

2.1.3 引入政府部门

如图 2-4 所示，从宏观的角度看，政府的功能无非是收和支。我们假设政府的收入完全来自个人所得税(T)，虽然现实中政府的收入来源多种多样。政府的支出分为两类：购买支出(G)和转移支付(TR)。当政府进行购买支出时，它要求得到收入者提供产品或服务。当政府进行转移支付时，它不提任何要求。从政府那里领取工资的交通警察必须在规定时间内站在规定的地方指挥交通。从政府那里领取失业救济金的失业者却不承担任何责任和义务，而且有可能在数钱的同时埋怨政府，甚至可以上街游行以表达自己的不满。