

教育部推荐教材

宏观经济学

主 编 李雄诒 周纪昌
副主编 陈艳芳 贺丽华 黄 鹂



北京师范大学出版集团
BEIJING NORMAL UNIVERSITY PUBLISHING GROUP
北京师范大学出版社

教育部推荐教材

宏观经济学

主 编 李雄诒 周纪昌

副主编 陈艳芳 贺丽华 黄 鹂



北京师范大学出版集团
BEIJING NORMAL UNIVERSITY PUBLISHING GROUP
北京师范大学出版社

图书在版编目(CIP)数据

宏观经济学 / 李雄诒, 周纪昌主编. —北京: 北京师范大学出版社, 2010.8
ISBN 978-7-303-11057-5

I. ①宏… II. ①李… ②周… III. ①宏观经济学—高等学校: 技术学校—教材 IV. ①F015

中国版本图书馆CIP数据核字(2010)第099649号

出版发行: 北京师范大学出版社 www.bnup.com.cn
北京新街口外大街19号
邮政编码: 100875

印 刷: 北京嘉实印刷有限公司
经 销: 全国新华书店
开 本: 184 mm × 260 mm
印 张: 20.75
字 数: 448 千字
版 次: 2010年8月第1版
印 次: 2010年8月第1次印刷
定 价: 35.00元

策划编辑: 周光明	责任编辑: 周光明
美术编辑: 高霞	装帧设计: 华鲁印联
责任校对: 李菡	责任印制: 李丽

版权所有 侵权必究

反盗版、侵权举报电话: 010—58800697

北京读者服务部电话: 010—58808104

外埠邮购电话: 010—58808083

本书如有印装质量问题, 请与印制管理部联系调换。

印制管理部电话: 010—58800825

前 言

宏观经济学是经济管理类的一门基础课，目前国内很多院校采用的是高鸿业教授主编的教材，这部教材是我国宏观经济学界的一部力作。由于近年来我国高等教育规模不断扩大，经济管理类本科生的专业很多，特别是教学课时安排差别很大；近年来宏观经济实践不断提出了新的挑战，这就要学生和教师共同面对现实，吸收国内外最前沿的理论观点，本书就是基于这种目的而编写的。

本书在整合现有国内外宏观经济学教材的基础上，结合我国宏观经济形势，进行系统地、全面地介绍宏观经济理论。主要有三大特点：（1）内容新颖、全面。涵盖目前国内外宏观经济学最新的研究前沿理论，并且做到简练、明确。如国家财富的性质、就业理论、通货紧缩等。（2）紧扣中国国情。在教学实践中很多同学反映宏观经济学距离现实太远，太抽象，本书紧密结合中国宏观经济的背景，时刻把握理论与实践的结合，使同学在理解抽象理论时做到本土化。（3）实用性强。本书参考国内近一些年来有关宏观经济学各种考试大纲和试题，特别是考试大纲，做到内容全面、应用广泛。

本书的内容是按照一个学期教学计划安排的，有些章节可以考虑省略或者作为教学的参考。重点内容是第一章宏观经济学的研究对象和方法；第二章国民收入核算；第三章简单国民收入决定理论 AE-NI 模型；第四章扩展的国民收入决定理论：IS-LM 模型；第五章宏观经济政策；第六章完整的国民收入决定理论：AD-AS 模型；第七章经济增长理论；第九章通货膨胀与通货紧缩；第十章失业和就业理论；而第八章经济周期、第十一章开放经济条件下的宏观经济问题；第十二章宏观经济学发展评析可以让学生自学。本书在内容安排上密切关注考试大纲，在讲课过程中有些内容可以略讲或者不讲。

本书主要是供经济管理类本科生公共必修课使用，在编写的过程中力求原理清楚，尽量避免使用复杂的数学工具，也可以作为其他专业学生学习宏观经济学的教材。参加本书编写的作者和具体分工：中原工学院经济管理学院院长李雄诒博士（第十二章）、中原工学院经济管理学院周纪昌（第一章、第二章、第八章）、中原工学院经济管理学院陈艳芳（第三章、第四章、第五章）、中原工学院经济管理学院贺丽华（第七章、第十章、第十一章）、河南工程学院经贸学院黄鹂博士（第六章、第九章），全书由李雄诒教授、周纪昌副教授修改定稿。

本书适合高等院校经济管理类学生使用，也适合其他专业学生学习宏观经济学知识使用，并适合经营管理人员作为学习宏观经济知识的参考书。

十分感谢出版社的编辑为此书出版付出的努力和辛勤劳动。同时更加感谢本书所参考的国内外教材的作者，由于教材编写体例的限制，不能作为文中注释形式清楚地注明参考内容的来源，只能粗略的在书后列举一些主要参考文献，一定会有一些遗漏，请各位专家原谅。当然书中出现的一切错误由我们负责。

编 者

2010 年 4 月 6 日于郑州

目录

第一章 宏观经济学的研究对象和

方法 1

第一节 宏观经济学的研究对象

..... 1

一、宏观经济学的定义 1

二、宏观经济学的研究对象 1

三、宏观经济学与微观经济学
的关系 3

第二节 宏观经济学的研究方法

..... 5

一、实证分析方法 5

二、经济理性主义的假定 6

三、均衡分析方法 7

四、静态、比较静态和动态
分析方法 7

五、总量分析 8

六、需求分析与供给分析 8

七、存量分析与流量分析 8

八、事前变量分析与事后变量
分析 8

第三节 现代宏观经济学的产生

与发展 9

一、现代宏观经济学产生时期
(20 世纪 20 年代末到 30
年代) 9

二、现代宏观经济学的鼎盛时期
(20 世纪 50 年代到 60 年代)
..... 11

三、现代宏观经济学的发展
时期 (20 世纪 70 年代到
90 年代) 16

【本章小结】 25

【复习思考题】 26

【推荐阅读】 26

第二章 国民收入核算 27

第一节 国内生产总值 27

一、国内生产总值与国民生产
总值 (GNP) 27

二、国内生产总值的含义 28

三、国内生产总值的缺陷 29

第二节 国内生产总值的核算方法

..... 31

一、支出法 (expenditure
approach) 31

二、收入法 (income approach)
..... 34

三、生产部门法 (sector
approach) 36

第三节 国民收入核算中的其他

总量 37

第四节 国民收入恒等式 41

一、两部门经济的储蓄—投资
恒等式 41

二、三部门经济的储蓄—投资
恒等式 42

三、四部门经济的储蓄—投资
恒等式 43

第五节 名义 GDP 与实际 GDP

..... 44

【本章小结】 48

【复习思考题】 48

【推荐阅读】 49



第三章 简单国民收入决定理论：AE-NI

模型 51

第一节 经济达到均衡的条件 51

一、最简单的经济体——两部门经济 51

二、两部门经济中经济达到均衡的条件 52

三、从非均衡向均衡的调节——非意愿存货投资的变动 53

四、三部门与四部门经济中经济达到均衡的条件 54

五、国民收入核算和国民收入决定的关系 55

第二节 消费函数与储蓄函数 55

一、消费和储蓄之间的关系 55

二、凯恩斯的消费函数——绝对收入假说 55

三、凯恩斯的储蓄函数 58

四、消费函数与储蓄函数之间的关系 59

* 五、其他消费函数理论 60

第三节 两部门经济中国民收入的决定与变动 63

一、两部门经济中均衡产出的决定 63

二、两部门经济中国民收入的变动——投资乘数 65

第四节 三部门经济中国民收入的决定与变动 66

一、税收为定量税时国民收入的决定 67

二、税收为比例税时国民收入的决定 68

三、政府财政政策对总产出的影响——三部门经济中的各种乘数 69

第五节 四部门经济中国民收入的决定和变动 72

一、四部门经济中国民收入的决定 72

二、四部门经济中国民收入的变动 73

【本章小结】 79

【复习思考题】 80

【推荐阅读】 80

第四章 扩展的国民收入决定理论：

IS-LM 模型 82

第一节 投资及其决定 82

一、投资、销售和利率 82

二、资本边际效率、投资边际效率与投资量的决定 82

三、托宾的 q 理论 84

第二节 产品市场的均衡：IS 曲线 85

一、IS-LM 模型的结构 85

二、IS 曲线及其推导 85

三、IS 曲线的斜率 87

四、IS 曲线的移动 88

第三节 货币市场的均衡：LM 曲线 88

一、货币的需求 88

二、货币供给与货币市场均衡 90

三、LM 曲线 91

第四节 产品市场、货币市场的同时均衡：IS-LM 模型 95

一、产品市场和货币市场的同时均衡 95

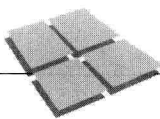
二、从不均衡到均衡的调整 96

三、IS-LM 模型的运用 97

第五节 IS-LM 模型的溯源与地位 104

一、IS-LM 模型的形成 104

二、IS-LM 模型的发展	104	第六章 完整的国民收入决定理论:	
三、IS-LM 模型在宏观经济学中 的地位	104	AD-AS 模型	140
【本章小结】	111	第一节 总需求与 AD 曲线	140
【复习思考题】	111	一、总需求的内涵及其构成	140
【推荐阅读】	112	二、总需求函数与 AD 曲线的 推导	141
第五章 宏观经济政策	113	三、AD 曲线的斜率及其经济 含义	145
第一节 财政政策理论与实践	113	四、AD 曲线的变动	147
一、财政政策工具	113	第二节 总供给与 AS 曲线	149
二、财政政策在 IS-LM 模型中 的反映	118	一、总供给的一般说明	149
三、挤出效应	119	二、长期总供给曲线	154
四、财政政策与 LM 曲线的两 种极端情况	120	三、短期总供给曲线	156
五、自动稳定器	121	四、常规总供给曲线	158
第二节 货币政策理论与实践	122	五、总供给模型的现实意义	159
一、中央银行与货币供给	122	第三节 宏观经济的均衡与变动	162
二、货币政策工具	127	一、国民经济的均衡与物价水平 的决定: AD-AS 模型	162
三、货币政策在 IS-LM 模型 中的反映	129	二、宏观经济的短期均衡	163
四、货币政策、IS 曲线的两种 极端情况与 LM 曲线区域 划分	130	三、宏观经济短期均衡的波动	164
五、货币政策传导机制	132	四、宏观经济的长期均衡	165
六、资本市场与货币政策	132	【本章小结】	169
第三节 财政与货币政策的混合 运用	134	【复习思考题】	170
一、财政与货币政策混合运用的 各种组合	134	【推荐阅读】	170
二、财政与货币政策组合的不同 选择	135	第七章 经济增长理论	172
第四节 宏观经济政策的时滞	135	第一节 经济增长的源泉	172
【本章小结】	138	第二节 增长理论的起源	174
【复习思考题】	139	一、重商主义的经济增长思想	174
【推荐阅读】	139	二、重农主义的经济增长理论	174
		三、亚当·斯密的经济增长 思想	176
		第三节 古典增长理论和“增长的 极限”	177

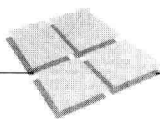


一、古典经济学中关于经济发展前景的“静止状态”思想	177
二、经济增长的生物物理极限	179
第四节 哈罗德—多玛模型	180
第五节 新古典增长模型	183
一、新古典增长模型	184
二、经济增长的测定和解释框架	187
第六节 内生增长理论	189
一、内生增长理论的含义	189
二、内生增长理论中的 AK 模型	191
【本章小结】	194
【复习思考题】	195
【推荐阅读】	195
第八章 经济周期理论	196
第一节 经济周期的含义与特征	196
一、经济周期的含义	196
二、经济周期的基本特征	197
第二节 关于经济周期的各种理论解释	197
一、“二战”前经济周期理论	198
二、“二战”后经济周期理论	200
第三节 乘数—加速数模型	201
一、加速原理	202
二、投资与乘数—加速数模型的基本思想	202
三、乘数—加速数模型	203
四、乘数—加速数模型的政策含义	204
第四节 总供给冲击与新古典经济周期理论	204

一、不完全信息经济周期理论	205
二、实际经济周期理论	206
第五节 经济周期在中国的表现	208
一、中国经济周期的轨迹及总体特征	208
二、中国经济周期各阶段的指标分析	210
三、经济周期波动计算方法	210
四、利用状态空间模型及卡尔曼滤波方法构建景气指数	211
【本章小结】	214
【复习思考题】	215
【推荐阅读】	215
第九章 通货膨胀与通货紧缩	216
第一节 通货膨胀	216
一、通货膨胀的概述	216
二、通货膨胀的成因	219
三、通货膨胀对经济的影响	223
四、中国的通货膨胀分析	226
第二节 通货紧缩	228
一、通货紧缩的概述	229
二、通货紧缩的成因	230
三、通货紧缩的影响	232
四、通货紧缩的治理	233
五、中国的通货紧缩	234
【本章小结】	237
【复习思考题】	237
【推荐阅读】	238
第十章 失业和就业理论	239
第一节 失业的概述	239
一、失业概念与统计	239
二、失业的类型	241
三、奥肯定律	241
第二节 失业的原因	242

一、供给—需求模型分析	242
二、新凯恩斯主义的工资黏性理论	243
三、发展经济学派的二元结构失业理论	244
第三节 失业与通货膨胀的关系：菲利普斯曲线	245
一、菲利普斯曲线的提出	245
二、菲利普斯曲线的政策含义	245
三、附加预期的菲利普斯曲线	246
四、长期菲利普斯曲线	246
第四节 就业理论	246
一、西方就业理论演进	246
二、西方就业理论对我国的启示	249
【本章小结】	252
【复习思考题】	252
【推荐阅读】	253
第十一章 开放经济条件下凯恩斯主义宏观经济模型：IS-LM-BP模型	254
第一节 开放经济的一般性问题	254
一、国际贸易简介	255
二、外汇与国际收支	261
三、汇率、外汇市场与汇率的决定	262
四、汇率制度	264
第二节 IS-LM-BP模型与宏观经济政策	265
一、净出口、净资本流出与BP曲线	265
二、IS-LM-BP模型	268
三、固定汇率制度下的宏观经济政策	269
四、浮动汇率制度下的宏观经济政策	271

五、开放经济条件下的宏观经济政策效应汇总简表	274
第三节 开放经济中的国际协调与合作——世界贸易组织与国际货币体系	275
一、世界贸易组织的形成与发展	275
二、国际货币体系的演化	277
三、区域经济一体化的发展	279
【本章小结】	281
【复习思考题】	281
【推荐阅读】	282
第十二章 宏观经济学评析	283
第一节 宏观经济学的思维模式与发展趋势	283
一、宏观经济学思维模式的演进	283
二、宏观经济学发展趋势分析	286
三、从宏观经济学的发展中得到启示与结论	286
四、西方宏观经济学发展的特点	287
第二节 宏观经济学取得的共识和争议	291
一、宏观经济学的四个最重要结论	292
二、宏观经济学四个重要的未解决问题	293
第三节 西方主流宏观经济分析的微观化评析	295
一、西方宏观经济学的演变	296
二、从凯恩斯倒退到斯密	302
第四节 中国宏观经济学的理论构架与创新发展	307
一、研究对象与分析角度的确立	308



二、非均衡概念的引入与宏观 经济的微观分析	308	一、新古典理论和凯恩斯理论的 简单述评	313
三、制度分析的引入	309	二、放松现有宏观经济理论的暗 含前提的必要性和有待研究 的新问题	313
四、预期与博弈分析的引入 ...	310	三、发展中国家宏观经济理论的 新革命	316
五、构造一个新框架的尝试 ...	310	【本章小结】	316
六、宏观经济学流派	311	【复习思考题】	317
七、微调经济思想	311	【推荐阅读】	317
八、开放视角中的宏观经济分析	311	主要参考文献	318
第五节 发展中国家宏观经济理论 的构建	312		

第一章 宏观经济学的研究对象和方法

【学习目的】通过本章的学习，熟练掌握宏观经济学研究对象、研究方法，熟练掌握宏观经济学关注的主要问题及其所涵盖的主要内容；了解宏观经济学产生和发展的历史，理解宏观经济学的发展与经济发展的内在联系，宏观经济理论产生和发展的一般规律。

第一节 宏观经济学的研究对象

一、宏观经济学的定义

经济学家们给宏观经济学下了各种大同小异的定义。例如：R. 多恩布什与 A. 费希尔说：“宏观经济学是研究整体经济行为的——高涨与衰退，经济中产品与劳务的总产量和产量的增长，通货膨胀与失业率，国际收支，以及汇率。为了研究经济的一般状况，宏观经济学集中在影响经济状况的经济行为与政策上——消费与投资，工资与价格变动的决定因素，货币与财政政策，货币存量，联邦预算，利率，公债。简而言之，宏观经济学研究当今的主要经济争论与问题。”

T. 德思伯格 (T. Dernburg) 给宏观经济学下的定义是：“‘宏观’一词的意思是大。而宏观经济学的意思是大经济学。宏观经济学家研究诸如总产量，总就业与失业，价格的总水平与变动率，经济增长率等总体问题。宏观经济学家所提出的问题涉及广泛的总量——与单个居民户支出决策的决定因素相对的所有消费者支出的决定；什么决定了所有厂商共同的资本支出，而不是单个厂商建立一个新厂的决定；与某个人为什么失业相对、决定经济中总失业水平的是是什么。宏观经济学衡量整个经济活动，它分析宏观经济政策所运用的这些活动的决定，它预测未来的经济活动，并且力图提出旨在预测与生产，就业和价格的目标值相一致的政策反应。”

宏观经济学是研究整体经济的运行规律的，它研究的是整个国民经济的经济行为。它研究的对象是影响整体经济的失业、通货膨胀、经济周期和经济增长这四个重大问题。经济学家正是通过对这些问题的研究，分析各种经济变量之间的关系从而找出经济运行的规律。解释这些宏观经济问题的内容就是宏观经济理论。

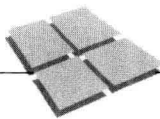
研究宏观经济的目的是为了整体经济稳定，即实现充分就业、物价稳定、经济周期平缓，以及适度的经济增长。这些目标要通过政策调节实现。因此，根据宏观经济理论制定的政策就是宏观经济政策。

用宏观经济政策调节经济需要定量分析各种经济变量的关系，进行经济预测，也需要评价政策，这就有了宏观经济计量模型，理论、政策、模型是宏观经济学三个相互关联的组成部分。

二、宏观经济学的研究对象

1. 总产出

对总产出水平的研究是宏观经济学的中心。对总产出的研究可以按照三个视角进



行。第一个视角是静态的，或称为短期的，即研究一国的年总产出水平是如何决定的。在一个较短时期内，技术水平、资源数量可视为不变。在这种情况下的最大总产出称为潜在总产出（或充分就业产出）。在一个经济体系中，如果实际总产出经常小于潜在总产出，那么，经济资源就是经常处于未被充分利用的状况之中。这样就产生了一个重要的宏观经济问题，即如何提高实际总产出水平，使之接近或达到潜在总产出水平。

第二个视角是动态的，即研究一国的总产出水平在一个经济周期内的波动是怎样形成的。在现代市场经济国家中，经济的周期波动是一个非常普遍的现象。一个完整的经济周期包括危机、复苏、繁荣、衰退四个阶段。经济周期的重要特征是总产出水平的波动。从静态的角度看，繁荣时总产出水平较高，危机时总产出水平较低。从动态的角度看，繁荣时总产出是增长的，危机时是下降的，也可能是这种情况：繁荣时总产出的增长率在提高，危机时总产出的增长率在下降。在不同国家或同一国家的不同时期，经济周期波动的波幅是不一样的，有的是剧烈的波动，有的是相对弱一些的波动。前面所言总产出从增长到下降就是较剧烈的波动、总产出的增长率由提高转为下降就是一种相对弱一些的波动。经济的剧烈波动，俗称“大起大落”，对经济效率的损害非常严重。宏观经济学需要研究：怎样使经济尽可能地避免剧烈的波动，而沿着较为平稳的路线向前发展。

第三个视角也是动态的，即研究一国经济在一个较长时期内是怎样增长的。这一部分理论称为经济增长理论。经济增长是指总产出水平在前期基础上的增加。经济增长面对的时期包括数个经济周期，因此是一个更长的时期。对经济增长的研究包括经济增长的量即经济增长率、经济增长中的结构变化、经济增长的实际效果等。经济增长理论需要研究：怎样使一个经济能够按一个较高的增长率稳定地增长、怎样通过产业结构的优化等提高经济效率的途径来促进经济增长，等等。本书主要研究关于经济增长率方面带有规律性的现象。

2. 就业

就业是宏观经济学关注的重要问题。宏观经济学主要研究一国总就业量或就业水平问题。这一研究的背景是在现代市场经济国家中失业问题存在的普遍性。对市场经济而言，一个较小比率（失业人数比具有劳动能力总人数）的失业或许是必要的。但是，实际失业超过这一比率就会给经济带来损害。大量失业意味着大量经济资源未加利用而闲置。这对一国总产出会产生巨大的负面影响。对应于这一较小比率失业的就业称为充分就业。怎样使劳动力实现充分就业是宏观经济学研究的重要问题。

3. 价格水平

宏观经济学研究的价格水平不是单个产品或单个要素的价格，而是一国物价总水平。在市场经济中，价格水平的波动是很平常的现象。从较长时期看，价格水平呈上升的趋势。价格水平的上升对经济有何影响是一个比较复杂的问题。无论如何，价格水平大幅度提高即通货膨胀对经济非常有害，而同时价格的大幅长期下降对经济也是不利的，这给宏观经济学提出一个课题，即怎样避免通货膨胀或通货紧缩来发展经济。

4. 国际收支和汇率

宏观经济学所要研究的以上三个问题是就封闭经济而言的。如果是一个开放经济，那么，宏观经济学还要研究关于国际收支和汇率方面的问题。国际收支和汇率本来是

国际经济学所要研究的对象。宏观经济学对它们的研究侧重于这个角度,即国际收支的变化或汇率的变化怎样影响一国总产出水平、就业水平和价格水平。在宏观经济学中,对一些国际经济问题的研究,最终还是要落脚到前三个问题上去。

三、宏观经济学与微观经济学的关系

1. 宏观经济学与微观经济学的区别和联系

微观的英文是“micro”,原意是“小”。微观经济学是以单个经济单位为研究对象,通过研究单个经济单位的经济行为和相应的经济变量单项数值的决定来说明价格机制如何解决社会的资源配置问题。宏观的英文是“macro”,原意是“大”。所谓宏观经济学则是以整个国民经济为研究对象,通过研究经济总量的决定及其变化,来说明社会资源的充分利用问题。二者的区别是明显的,主要表现在:

(1) 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,研究整个经济的运行方式与规律,从总量上分析经济问题。正如萨缪尔逊所说,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“宏观经济学考查国民经济作为一个整体的功能”。

(2) 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。

(3) 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”。

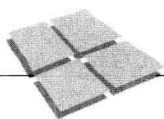
(4) 基本假设不同。微观经济学的基本假设是市场出清、完全理性、充分信息,认为“看不见的手”能自由调节实现资源配置的最优化。宏观经济学则假定市场机制是不完善的,政府有能力调节经济,通过“看得见的手”纠正市场机制的缺陷。

(5) 中心理论和基本内容当然也不同。微观经济学的中心理论是价格理论,还包括消费者行为理论、生产理论、分配理论、一般均衡理论、市场理论、产权理论、福利经济学理论、管理理论等。宏观经济学的中心理论则是国民收入决定理论,还包括失业与通货膨胀理论、经济周期与经济增长理论、开放经济理论等。

微观经济学和宏观经济学虽然有明显的区别,但作为经济学的不同分支,共同点也是明显的:一方面,只是从不同角度对经济现象进行的分析,采用的都是实证分析方法,即都把社会经济制度作为既定的,不涉及制度因素对经济的影响,从而与制度经济学区分开来。另一方面,微观经济学先于宏观经济学产生,发展得比较成熟,因而是宏观经济学的基礎;两者互相补充,互相渗透,共同组成了经济学的基本原理。

2. 宏观经济学的微观基础

新古典经济学研究个人与企业的决策和资源配置问题,而没有关注整体经济的运行。20世纪30年代的大萧条打破了萨伊定理,经济学发生了第一次危机。正是在这种背景下产生了以总需求分析为中心的凯恩斯主义宏观经济学。经济学的中心由资源配



置转向资源利用,由个体转向整体。这是经济学中的一次革命。后人评价说,经济学中的这场“凯恩斯革命”与天文学中的“哥白尼革命”同样重大。今天看来,这个评价并不过分。凯恩斯提出,“我认为,经济学分为两部分,一部分是关于单个行业与企业、报酬,以及既定资源量分配的理论;另一部分是关于整体经济产出与就业的理论”。

20世纪70年代初美国高失业与高通货膨胀并存的滞胀动摇了战后凯恩斯主义一统江湖的地位。对凯恩斯主义的批评不仅在政策和具体理论上,更重要的是在一个根本问题上:凯恩斯主义宏观经济学缺乏微观经济基础。个人经济决策与活动是整个经济的基础,整个经济无非是个人经济活动的总和结果。离开解释个人经济活动的理论——微观经济学——将不会有解释整体经济的宏观经济学,但庞大宏伟的凯恩斯主义经济学体系所缺乏的正是这个基础。

关于宏观经济学的微观基础问题,一直是激烈争论的问题,这里有必要多说一些。宏观经济理论,无论是凯恩斯主义还是货币主义,都把微观经济理论所探讨和得出的某些原理当做既定的前提加以接受,诸如价值形成问题、收入分配的依据问题等并不包括在他们的理论之中。也就是说,宏观经济学一直缺乏自己的微观经济学基础。寻找微观基础一直是宏观经济理论研究者孜孜不倦的工作。

(1) 对于凯恩斯宏观经济学的微观基础问题,主要有两种看法:萨缪尔逊早就提出,用新古典经济学的微观理论,即边际效用价值论和边际生产力分配理论作为凯恩斯宏观经济学的微观基础,因而被称为“新古典综合派”;另外以卡尔多、琼·罗宾逊为首的凯恩斯主义者则认为,要从李嘉图的价值理论和分配理论中寻找宏观经济学的微观基础,要承认价值本身有客观的、物质的基础,承认分配问题不能脱离特定历史条件和所有权因素来考查。凯恩斯经济学的微观基础问题,实际上是凯恩斯主义中两大分支——新古典综合派与新剑桥学派——之争,这个争论还在继续进行。

(2) 货币主义宏观经济理论的微观经济学基础问题,货币主义者们、尤其是所谓第二代通货膨胀研究者们进行了补充和发展。他们认为,人们的预期的形成与市场信息之间存在着密切的关系,而市场信息的获得不仅需要成本,而且难以充分。因此,只分析宏观经济学领域中货币流通总量和利息率水平,不分析微观经济学领域中的人们对工资和价格的预期、市场信息的传递方式,是显然不够的。

(3) 希克斯在宏观经济学和微观经济学的结合问题上走了一条独特的道路,既不同于凯恩斯主义,也不同于货币主义。早在20世纪30年代,他在《价值与资本》一书中就着手于二者结合的尝试,在他的理论中,微观理论和宏观理论是一致的。

宏观经济学是研究经济的总体行为、考查经济的总体趋势的学问,而经济的总体趋势是经济中数以百万计的单个经济个体的行为加总的结果,因此,宏观经济理论必须与构成经济的数以百万计的家庭和企业的微观基本行为相一致。为此,现代宏观经济学采取三个基本步骤:首先,试图从理论水平上理解单个家庭和企业的决策过程。他们假定经济中存在一个典型的或平均的家庭或企业,然后利用微观经济学的工具研究它们在各种不同的经济环境中怎样以及将要怎样行为。其次,宏观经济学家试图通过加总经济中个别家庭和企业的行为,来解释经济的整体行为。他们将典型家庭或企业的行为以某种适当的方法加以“复合”(multiplied),把经济中的关键变量如价

格、产量、消费量等加总，然后推导出整体数据间的各种不同关系，以图解释关键经济变量间的联系。再次，通过收集并分析实际宏观经济数据以赋予理论经验内容，验证理论的有效性。宏观经济学就是这样运用微观经济学理论来不断完善自己的理论体系的。

▶ 第二节 宏观经济学的研究方法

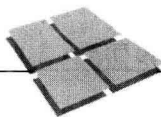
理论学习必须重视研究方法的探究，宏观经济学研究方法除了一般微观经济学的研究方法外，它还具有一些特点，它采取三市场划分：金融市场、产品和服务市场、要素市场；对于市场主体划分为三种主体：家庭、企业和政府；宏观经济学在很大程度上就是研究这三种行为主体在以上三种市场中的行为方式及其相互作用，同时还采用一些具体的研究方法。

一、实证分析方法

实证分析方法的精神实质就是揭示经济现象之间的因果联系。例如，就通货膨胀问题来说吧，实证分析首先要解决的问题是当前通货膨胀的程度如何，即按某一种规定对通货膨胀的程度加以测度。其次要解决的问题是通货膨胀是怎样产生的。这里已经出现宏观经济现象之间的因果联系了。果是通货膨胀，因是实证分析所要寻找的引起通货膨胀现象的另一些经济现象。然后需要研究通货膨胀对经济有何影响。这里又出现了因果联系，通货膨胀是因，受到通货膨胀影响的其他经济现象是果。再次，实证分析还需要研究：采取哪些政策措施可以降低通货膨胀率。在这里，政策措施是因，通货膨胀率的降低是果。依据研究目的不同，实证分析有时抓住因果联系中的因，有时抓住其中的果。

具体地看，实证分析对客观经济现象因果联系的把握有两种不同的方法。一种称为经验实证，另一种称为逻辑实证。经验实证就是把对个别经济现象因果联系的认识上升到理论的高度，即从中挖掘出一般性的规律性认识。经验实证方法就是归纳的方法、调查研究的方法、“解剖麻雀”的方法。其认识路线是从个别到一般。经验实证的短处是：由经验实证所得到的具有普遍意义的因果联系是对个别因果联系的推广，这就必然存在认识逻辑上的中断。

作为理论经济学，宏观经济学主要采用逻辑实证的研究方法。逻辑实证的方法也被称为演绎的方法，或抽象分析的方法，和经验实证相反，逻辑实证的认识路线是从一般到个别。逻辑实证对因果联系的把握是从建立假设开始的。逻辑实证建立假设就好像自然科学建立实验室，借此排除一切无关和次要的因素，保留少数有关的重要因素，从而能够在一种“纯粹”的环境中观察现象之间的因果联系。当然，经济学中的这一“实验室”是在思维中建立的。逻辑实证分析中的假设也好像作为理论自然科学体系发端的公理。这些公理是不能被证明的，但只要人们接受这些公理，就能一步一步地推演出整个理论大厦来。逻辑实证分析中假设的重要性可见一斑。在宏观经济学中，有两类假设。一类假设纯粹是为了讨论的方便，对立论不会发生根本的影响。例如一个只包含企业和家庭的简单经济的假设就是如此。在这一假设中得到的一些基本结论不会因为在经济系统中增加一个政府部门而发生根本的改变。另一类假设就不同



了。例如假设经济是完全竞争市场还是假设经济是不完全竞争市场。在这一场合，假设不同，推导的结论就不同。显然，在宏观经济学中，这一类假设具有更加重要的理论意义。

逻辑实证的第二步是在建立假设的基础上，利用数学等手段合乎逻辑地推导出有关结论以描述宏观经济现象之间的因果联系。初、中级宏观经济学经常利用的数学手段有几何图形、函数、方程、极值的求解、初等微积分等。例如，根据若干假定，可以得到一条向右下方倾斜的货币需求曲线以及垂直的货币供给曲线。利用这两条曲线以及曲线的移动就可以观察到货币供给量增加必然引起市场利息率下降这种因果联系。

在逻辑实证研究中，最后的结论是在建立假设的基础上通过严格的数学推导得到的。因此，在假设前提和结论之间不存在任何认识逻辑的中断。这是无可怀疑的。但是，逻辑实证的命题仍然需要接受现实的检验。如果逻辑实证的命题与现实有较大的差距，那么，这一命题是值得怀疑的。由于结论是在假设前提的基础上经过严格推导得到的，因此，值得怀疑的不是结论，而是结论赖以存在的假设前提。这就需要改变假设前提，以改变了的假设前提为基础，重新进行逻辑实证研究。

实证研究着重描述客观经济现象之间的因果联系，而不涉及对这些因果联系进行“好或坏”、“应该或不应该”之类的优劣评价。评价经济现象优劣的研究称为规范研究。但是，任何实证研究都至少包含某些最基本的规范含义。例如，宏观经济学进行的实证研究，是以对资本主义市场经济制度的基本肯定为其前提的。

二、经济理性主义的假定

经济理性主义的假定是现代西方经济学，包括微观经济学和宏观经济学，贯彻始终的最重要的假定之一。经济理性主义的假定是指在进行逻辑实证的研究过程中，总是假定当事人非常明确行为目标，在经济决策时，总是深思熟虑地进行权衡比较，选择最佳方案，以期获得尽可能大的利益。在微观经济学中，考查消费者的购买决策、企业的产出决策和投入决策等，都以理性主义的假定为其前提。宏观经济学对“总体行为”的考查，同样以理性主义的假定为其前提。在宏观经济学中，理性主义的假定表现为一系列“总体行为”函数，如劳动供给函数、劳动需求函数、消费函数、投资函数、货币需求函数等。例如，劳动供给函数表现总体工人利益最大化的劳动供给量是怎样决定的，劳动需求函数表现总体企业利益最大化时对劳动的需求量是怎样决定的，等等。

以经济理性主义为基本出发点是经济学研究人的行为从而经济现象独特的视角。这一独特的视角实际上隐含了经济学研究对当事人追求最大利益行为的肯定。从这一基本倾向出发，当个别行为甚至“总体行为”与社会最优相悖时，经济学不去简单地指责追求最大利益行为本身，而是探求使当事人选择这种追求最大利益行为的外部条件，如技术、资源、体制等。经济学研究的任务正是要着力描述的技术、资源、体制等外部条件与追求最大利益行为之间的因果联系，并通过这种研究指出通过改变技术、资源、体制等外部条件促使当事人追求利益的最大化与社会最优趋于一致。例如，宏观经济学的研究揭示了总体家庭最优消费计划和总体企业最优投资计划未必使总需求达到足以实现充分就业的程度。在这种情况下，经济学不去指责微观单位最优支出计划本身，而是试图解释微观单位最优支出计划（就社会最优而言的）不足的原因，并

在解释的基础上提出通过改变影响微观单位最优支出计划的外部条件以及通过微观单位最优支出计划的实施来扩大总需求实现充分就业的对策。

三、均衡分析方法

现代西方经济学对经济现象的研究着重刻画经济现象的均衡状态。均衡概念是经济学从自然科学中借用来的。在力学中,均衡可以指在大小相同方向相反的两个力的作用下,物体的位置保持不变。在经济中,均衡的这层意思基本上保留下来了。经济学中的均衡具体描述三种情况:第一种情况是经济当事人利益最大化状态。在微观经济学中,使消费者效用最大化的商品购买方案称为消费者均衡,使厂商成本最小的要素购买方案称为生产者均衡。为什么经济当事人利益最大化状态称为均衡呢?这是因为若价格等因素不变,则这样的购买方案就“维持不变”。“维持不变”正好体现了均衡的含义。在宏观经济学中,利益最大化的总体行为用一系列总体行为函数刻画,如消费函数、投资函数等。这些总体行为函数虽然没有冠以均衡的名称,却已隐含了均衡的意义。例如,宏观经济学认为消费支出是可支配收入的函数,因此,如果可支配收入不变,那么,消费支出保持不变。这里的“保持不变”正是一种均衡。

第二种情况是市场供给与需求的均衡。市场供求均衡正是均衡概念通常包含的意思。一般而言,供给反映了供给者的最大利益,是价格的增函数;需求反映了需求者的最大利益,是价格的减函数。意愿供给量和意愿需求量不一致就会引起价格的波动。价格的变动反过来会引起意愿供给量和意愿需求量的变化。当价格处于某一水平时,意愿供给量恰好等于意愿需求量,这样价格就不再变动了,交易量也就稳定下来。市场供求达到均衡。在这里,均衡仍然取“不再变动、稳定下来”的含义。当然,均衡也包含供给量和需求量“达到一致”的含义。

第三种情况是市场供给与需求的非均衡状态维持不变。这是较后赋予均衡的含义。在这里,均衡已经不包含供给与需求一致的意思,但仍包含该状态“维持不变”这一均衡的基本含义。这种非均衡的均衡在宏观经济学中具有非常重要的意义。

我们观察到的宏观经济现象通常处于经济的变动之中。那么,研究经济现象“保持不变”的状态有何意义呢?对均衡状态的研究实际上就是对经济现象运动趋势的研究。这种研究对于揭示经济现象发生的前因后果是很有益的。

四、静态、比较静态和动态分析方法

现代经济学对经济均衡的研究有静态、比较静态和动态这三个角度。

静态分析方法是一种初步的从而比较简单的分析方法。它着重刻画均衡状态的特征以及形成均衡状态的条件。它假设经济变量从非均衡到均衡的调整是在一瞬间完成的。在静态分析中,没有时间这一维度。这与现实显然相差甚远。但是,利用静态分析至少使我们初步地把握经济现象运动的规律,从而为更进一步的认识奠定了一个基础。

比较静态分析是从静态分析发展而来的。它着重研究两个均衡状态之间的联系,揭示一个均衡状态必定沿着哪个方向过渡到另一个均衡状态。至于这种“过渡”,比较静态分析沿袭静态的眼光,即仍然假定它是在一瞬间完成的。

动态分析把经济变量的调整放到时间这一维度中考查,比前两种方法更加前进了一步。在宏观经济学中,对通货膨胀、经济周期、经济增长等经济现象的研究都是按动态的视角展开的。