

● 主审 魏杰



世纪高等教育经济学·管理学核心课系列教材

21SHIJI GAODENGJIAOYU JINGJIXUE · GUANLIXUE HEXINKE XILIEJIAOCAI

MACROECONOMICS

宏观经济学

● 主编 刘兴海 程瑜



西北大学出版社

NORTHWEST UNIVERSITY PRESS

21 世纪高等教育经济学·管理学核心课系列教材

宏观经济学

主 审	魏 杰		
主 编	刘兴海	程 瑜	
副主编	杨小卿	刘 勇	
	杨 屹	王莉芳	

西北大学出版社
中 国 · 西 安

图书在版编目 (CIP) 数据

宏观经济学/刘兴海, 程瑜主编. —西安: 西北大学出版社, 2003.8

ISBN 7-5604-1892-9

I. 宏… II. ①刘…②程… III. 宏观经济学 - 高等学校 - 教材 IV. F015

中国版本图书馆 CIP 数据核字 (2003) 第 074826 号

宏观经济学

主编 刘兴海 程瑜

西北大学出版社出版发行

(西北大学校内 邮编 710069 电话 8302590)

新华书店经销 西安华新彩印有限责任公司印刷

850 毫米×1168 毫米 1/32 开本 12.25 印张 300 千字

2003 年 8 月第 1 版 2003 年 8 月第 1 次印刷

ISBN 7-5604-1892-9/F·257 定价: 22.00 元

前 言

本书是与西北大学出版社新近组编的《微观经济学》配套使用的宏观经济学教材。主要供大学本科或专科经济类专业和管理类专业学生使用，也适用于非经济管理专业的学生及广大读者自学，也可供研究生及攻读硕士学位的学生做参考。

本书旨在全面、客观、准确地介绍现代宏观经济学的基本概念、基本原理及基本分析方法，从整体上说明宏观经济运行中的各类变量及相互关系，阐述宏观经济运行的内在逻辑规律，分析政府宏观经济政策的制定及实施效果，为政府制定合理可行的宏观经济政策提供必要的理论依据。同时也为广大的消费者及企业决策单位提供在行为安排方面所必需的宏观经济理论背景知识。

本书具有如下一些明显特征。

1. 在国外的大学中，经济学教学大致分为初级和中级两个层次。而我国许多大学的经济学教学还只有一个阶段，学生在这个阶段中只能有限地了解现代经济科学的一部分内容，为适合我们特殊的高等财经教育的要求，本书将初级和中级宏观经济学进行有机的结合，一方面介绍初级宏观经济学的主要基本理论，另一方面，又有取舍地融合了中级宏观经济学的一些基本分析方法，同时在内容和结构的安排中积极吸收 80 年代以后宏观经济学研究的新成果。

2. 考虑到使用对象的实际水平，本着因材施教的原则，本书的编写以介绍宏观经济学的基本理论和方法为宗旨，以文字叙述为主，尽可能地避免使用复杂的数学工具，相关模型的建立和

使用大多以几何图形及初等数学知识加以表现,力求简单易懂,也便于教学。

3. 在理论体系结构的安排上,以国民收入决定为中心线索,集中讨论国民收入决定的整个过程,然后再说明围绕国民收入决定所产生的几个宏观经济现象。这样安排,逻辑线索清晰,易于教学和学生理解掌握。

4. 为了便于学生加深理解,本书还配有若干案例。这些案例紧扣理论分析,同时尽可能地结合我们的实际生活,给学生提供一些分析问题的方法和思路。为了便于教学,各章后面还设有若干复习思考题。

在本书编写之时,我们即荣幸地邀请到著名经济学家、清华大学教授魏杰担任本书主审。魏杰教授在百忙之中抽时间审阅了书稿,并提出了宝贵意见。我们在此对魏杰教授的大力支持表示衷心的感谢!

本书编写组在对目前国内外许多同类版本进行多次研讨的基础上,拟定并反复修改了本书的编写大纲。西安财经学院教授刘兴海和西安交通大学经济金融学院博士程瑜担任本书主编,西北大学经济管理学院副教授杨小卿、西安财经学院刘勇、西安理工大学副教授杨屹和西北工业大学王莉芳担任本书副主编。本书的编写成员及分工如下:西安交通大学经济金融学院程瑜(第一章)、西安财经学院张颖(第二章)、西安理工大学杨屹(第三章)、西安财经学院刘兴海(第四章)、西北工业大学王莉芳(第五章、第十二章)、西安财经学院刘勇(第六章)、西安财经学院李建平(第七章)、西北大学经济管理学院杨小卿(第八章)、西北大学岳宏志和寇雅玲(第九章)、西北工业大学王颖晖(第十章)、西北大学杨建飞和范王榜(第十一章)。另外,西安交通大学程瑜撰写了第三章的案例,西安财经学院刘勇撰写了第八章的案例1,西北大学经管学院99级经济学基地班学生卢磊撰写了

第八章的案例2，西北大学岳宏志撰写了第九章的案例。

本书在编写过程中参考了大量同类教材和著作，我们在此向这些参考书的作者表示感谢。主要参考书目已列于书后。

我们虽然已经尽力想把本书编写好，但由于水平所限，缺点和错误一定难免，诚请读者批评指正。

编 者

2003年7月

目 录

第一章 宏观经济学的对象与理论体系	(1)
第一节 宏观经济学的研究对象	(1)
一、宏观经济学的研究对象.....	(1)
二、宏观经济学的基本问题.....	(5)
第二节 宏观经济学的产生和发展	(13)
一、早期的宏观经济学	(14)
二、现代宏观经济学	(16)
第三节 宏观经济学的研究方法	(29)
一、一般方法与基本假定前提	(30)
二、具体分析方法	(31)
第二章 国民收入核算	(37)
第一节 国民收入核算的指标体系	(37)
一、国民收入核算体系	(37)
二、国内生产总值	(38)
三、国民收入核算的其他总量	(42)
第二节 国内生产总值的计算方法	(45)
一、支出法	(46)
二、收入法	(48)
第三节 国民收入核算的作用与局限性	(50)
一、国民收入核算的作用	(50)
二、国民收入核算的局限性	(52)
第四节 总体经济活动的循环流动	(55)
一、参与总体经济活动的部门	(55)

二、两部门经济的循环流动	(56)
三、三部门经济的循环流动	(60)
四、四部门经济的循环流动	(61)
第三章 消费、储蓄和投资	(64)
第一节 消费与储蓄	(64)
一、家庭消费函数	(64)
二、家庭储蓄函数	(68)
三、消费函数与储蓄函数的关系	(71)
第二节 投资	(72)
一、资本的效率	(72)
二、投资函数	(76)
第三节 总支出、总收入和均衡收入	(77)
一、总支出	(77)
二、总收入	(78)
三、均衡收入	(79)
第四章 简单国民收入决定理论	(85)
第一节 国民收入的决定	(85)
一、两部门经济国民收入的决定	(85)
二、三部门经济国民收入的决定	(88)
三、四部门经济国民收入的决定	(89)
第二节 乘数原理	(90)
一、投资乘数	(90)
二、投资乘数作用的过程	(91)
三、其他乘数	(94)
第三节 加速原理	(99)
一、加速原理的初步说明	(99)
二、加速原理的进一步说明	(102)
第五章 货币理论与资产市场的均衡	(105)

第一节 货币的定义与职能	(105)
一、货币的定义和度量	(105)
二、货币的职能	(106)
第二节 货币的需求	(108)
一、影响货币需求的因素和货币需求函数	(108)
二、货币需求弹性	(116)
三、货币流通速度	(117)
四、货币数量论	(117)
第三节 货币的供给	(123)
一、货币供给的界定	(123)
二、银行体系	(124)
三、货币创造	(132)
四、货币供求均衡和利率的决定	(135)
第四节 资产市场的均衡	(137)
一、资产的需求	(137)
二、资产市场的均衡	(141)
第六章 劳动市场均衡及总供给模型	(148)
第一节 总量生产函数	(148)
一、总量生产函数的定义	(148)
二、总量生产函数的性质及图形	(150)
第二节 劳动市场的均衡	(150)
一、劳动市场的需求	(151)
二、劳动市场的供给	(152)
三、劳动市场均衡	(155)
第三节 总供给模型	(158)
一、总供给的基本问题	(158)
二、古典学派的总供给模型	(158)
三、凯恩斯学派的总供给模型	(160)

第七章 IS—LM 模型及总需求—总供给模型	(168)
第一节 产品市场的均衡：IS 曲线	(168)
一、IS 曲线的产生	(168)
二、IS 曲线的移动	(172)
三、三部门经济的 IS 曲线	(174)
第二节 货币市场的均衡：LM 曲线	(177)
一、货币市场均衡与 LM 曲线	(177)
二、LM 曲线的移动	(180)
第三节 IS—LM 模型	(181)
一、产品市场与货币市场的同时均衡	(182)
二、自发总需求变动对 IS—LM 的影响	(185)
三、货币量变动的影响	(186)
四、IS 曲线与 LM 曲线同时移动对产品市场和货币 市场均衡的影响	(187)
五、古典学派与凯恩斯学派的 IS—LM 模型	(188)
第四节 总需求—总供给模型：AD—AS 模型	(191)
一、总需求曲线	(191)
二、总供给曲线	(196)
三、AD—AS 模型	(198)
四、货币中性论	(201)
第八章 失业理论与通货膨胀理论	(203)
第一节 失业理论	(203)
一、失业的概念	(203)
二、失业的类型	(204)
三、失业的危害	(206)
第二节 通货膨胀理论	(206)
一、通货膨胀的概念、特征及程度	(206)
二、通货膨胀的成因及类型	(209)

三、通货膨胀的国际根源·····	(213)
四、通货膨胀的社会经济效应·····	(214)
五、通货膨胀的治理措施·····	(215)
六、通货紧缩的概念、成因、效应与治理·····	(216)
第三节 失业与通货膨胀的相互关系·····	(217)
一、凯恩斯对失业与通货膨胀关系的分析·····	(217)
二、菲利浦斯曲线及其恶化·····	(219)
三、新古典综合派对失业与通货膨胀并发症的解释·····	(223)
四、失业与通货膨胀并发症的对策·····	(225)
第九章 经济增长理论·····	(237)
第一节 经济增长概论·····	(238)
一、经济增长的定义·····	(238)
二、经济增长的衡量·····	(238)
三、经济增长的价值·····	(239)
第二节 古典经济增长模型·····	(240)
一、哈罗德—多马模型的基本表达式·····	(241)
二、哈罗德—多马模型的三种经济增长率·····	(242)
三、哈罗德—多马模型对经济波动的解释·····	(243)
第三节 新古典经济增长模型·····	(245)
一、米德模型的假设条件·····	(246)
二、米德模型的基本表达式·····	(246)
三、米德模型的经济含义·····	(249)
第四节 新剑桥经济增长模型·····	(250)
一、假定条件·····	(250)
二、模型设定·····	(250)
三、经济均衡稳定增长的实现问题·····	(251)
第五节 新经济增长理论·····	(253)
一、新古典经济增长理论存在的问题·····	(253)

二、罗默的新经济增长理论	(254)
三、卢卡斯的新经济增长理论	(257)
第六节 经济增长的因素分析	(258)
一、肯德里克对经济增长因素的研究	(259)
二、丹尼森对经济增长因素的研究	(260)
三、经济增长的四大因素	(261)
6 第十章 经济周期理论	(265)
第一节 经济周期的定义、特征及类型	(265)
一、经济周期的含义	(265)
二、经济周期的特征	(266)
三、经济周期的类型	(269)
第二节 经济周期与宏观经济指标	(273)
一、经济指标的循环性：方向与动因	(275)
二、经济周期与产出缺口	(279)
三、通货膨胀、失业与经济周期	(281)
四、经济周期与股票价格	(285)
第三节 经济周期的分析	(287)
一、经济周期的 AD—AS 模型分析	(287)
二、总需求与总供给冲击	(288)
三、传统经济周期理论	(290)
四、凯恩斯主义经济周期理论	(299)
五、新凯恩斯主义经济周期理论	(300)
第十一章 宏观经济政策	(304)
第一节 财政政策	(304)
一、财政支出政策	(305)
二、财政收入政策	(307)
三、预算赤字与政府债务	(309)
第二节 货币政策	(312)

一、货币政策的作用机制及种类	(312)
二、货币政策的主要措施	(315)
三、货币主义的货币政策	(319)
第三节 收入政策与人力政策	(320)
一、收入政策	(321)
二、人力政策	(322)
第四节 宏观经济政策的相机抉择	(323)
一、内在稳定器	(323)
二、相机抉择	(324)
三、宏观经济政策目标的协调	(325)
第十二章 开放条件下的宏观经济理论和政策	(328)
第一节 开放经济中的储蓄与投资	(328)
一、开放程度及对一国经济的影响	(328)
二、国际收支平衡表	(329)
三、开放经济中的产品市场均衡	(333)
四、开放经济中的储蓄和投资	(334)
第二节 汇率政策和宏观经济政策	(338)
一、汇率及汇率的决定	(339)
二、开放条件下的宏观经济模型: IS—LM—FE 模型	(344)
三、浮动汇率制度下的宏观经济政策	(347)
四、固定汇率制度下的宏观经济政策	(352)
第三节 国际货币制度的演变	(357)
一、金本位制	(359)
二、金汇兑本位制	(364)
三、布雷顿森林制度	(366)
四、浮动汇率制度	(370)
主要参考文献	(374)

第一章 宏观经济学的对象 与理论体系

1

在现代经济科学的构成中，宏观经济学是其重要的组成部分，并与微观经济学形成姊妹篇。宏观经济学不但成为各国政府调控经济运行，制定经济政策的理论工具，也在不断发展中形成了具有自身特征的逻辑理论体系。在进入宏观经济学的整个理论学习之前，有必要对该门学科的基本对象、理论体系及基本分析方法作简要介绍，使我们对宏观经济学有个概括了解，同时掌握本书的内容结构安排。

第一节 宏观经济学的研究对象

一、宏观经济学的研究对象

宏观经济学 (Macroeconomics) 是以整个国民经济作为其研究对象的，它通过研究在经济活动中各有关经济变量的决定和相互关系，以说明一国经济运行中宏观总量的内在均衡过程。具体地说，宏观经济学研究国民收入的决定和变动、长期的经济增长和短期的经济波动以及与之相关的通货膨胀、失业和国际收支等现象，揭示这些经济现象所产生的原因及其相互关系，以期由政府制定宏观经济政策提供理论依据，为消费者、企业和投资者等微观利益行为主体提供经济运行的背景知识。对此，还可从以下

几点作一解释。

首先,从本质上讲,宏观经济学所关注的中心问题是国民经济运行的总体状况,说明一国经济增长的目标是如何实现的,在实现经济长期增长中短期波动的原因及对应的政策措施是什么。正如著名经济学家费希尔所说:“宏观经济学既考察长期的经济增长,也考察构成经济周期的短期波动。”^①

其次,宏观经济学主要通过对一些宏观经济总量变量的观察,对一些有关国民收入决定过程的模型的阐述,以说明整个国民经济的运行规律。在宏观经济学中涉及到许多变量,大致可分为两类,一类是流量,另一类是存量,它们都是用来反映和体现不同的经济状况的。这些变量之间的关系是随机的,宏观经济学就是通过对这些变量的系统性分析,以确定它们之间的相互关系,进而说明一国国民经济的总体运行规律。

第三,宏观经济学是为政府制定正确的经济政策提供理论依据的。一个国家的政府为了在经济增长中体现自己的意志,实现自己的经济社会目标,调整经济总量的内在结构,必须制定相应的宏观经济政策以影响社会有效需求和供给,这些经济政策的理论基础就来源于宏观经济学。目前,我们在经济生活中,主要涉及到两个基本的宏观经济政策——财政政策和货币政策。财政政策主要在于通过控制政府的公共支出和税收影响有效需求,而货币政策则利用货币存量的变动影响均衡利率水平,进而通过利率影响私人投资行为,改变和影响社会总需求。除此以外,70年代以来,随着新的“滞胀”危机的出现,在经济政策的研究中,一些经济学家也认为,就对社会总供给的直接影响来看,宏观经济政策还应包括人力政策、收入政策和对外贸易政策等等。而

^① [美] 多恩布什、费希尔:《宏观经济学》,中国人民大学出版社1997年版,第3页。

且,所有这些政策在实践中还存在着面对具体的经济态势进行选择 and 搭配的问题。

第四,宏观经济学还涉及到一国国民经济全面发展的动态均衡问题。从一国经济发展的长期考虑,宏观经济在发展中由于受多种因素的影响可能会发生短期性的波动,这种波动的不同幅度都会对经济稳定增长造成不同的影响和损害,宏观经济学将从整体上探索产生经济波动的内在原因,说明在一定时期制约国民经济增长的因素及其关系,说明在经济增长中为什么会发生周期性的经济波动。

到目前为止,西方经济学家给宏观经济学下了许多很不统一的定义,如:美国著名的经济学家多恩布什·费希尔认为:“宏观经济学所关心的是整体的经济行为——它涉及繁荣与衰退,经济中商品和劳务的总产出与产出的增长,通货膨胀与失业率,国际收支和汇率。”^① 奥利弗·布兰查德说:“宏观经济学研究总的经济变量,如总产量和平均价格水平”^②。而美国现代著名的经济学家保罗·萨缪尔森认为:“宏观经济学论述整个经济的行为——或经济生活的宏观总量。它研究一国产出、就业、失业和价格的总的水平。”^③ 如此等等。可以看出,这些定义从不同的角度说明了宏观经济学研究的中心内容,尽管语言表达差别很大,但都强调整体变量运行规律这个中心。

另外,宏观经济学与微观经济学作为理论经济学的两个重要组成部分,虽然在具体的研究对象和分析视角上有较大差别,但

① [美] 多恩布什、费希尔:《宏观经济学》,中国人民大学出版社 1997 年版,第 3 页。

② Olivier Blanchard: *Macroeconomics*, 清华大学出版社, Prentice - Hall International, Inc. P1。

③ [美] 保罗·A. 萨缪尔森、威廉·D. 诺德豪斯:《经济学》(第 12 版),中国发展出版社 1992 年版,第 129 页。

是它们都是对人类经济活动的反映，存在密切关系，要正确地理解宏观经济学的研究对象范围，应当关注这两者之间的关系。第一，微观经济学是宏观经济学的基础。由于整体经济学是单个经济活动的总和，各种不同的经济利益主体为了达到自己的目的，在不同的领域从事不同的经济活动，相互之间形成复杂的经济关系。这些经济关系要靠不同的经济定量指标来反映其程度和规模，以成为人们进行经济决策的信息。因此，作为研究整体经济活动规律的宏观经济学就必须对影响和形成这些复杂关系的微观行为基础进行系统的研究，以探索宏观经济活动的内在规律。正如美国经济学家约瑟夫·斯蒂格利茨所言：“在过去的几十年间，经济学家开始对微观经济学和宏观经济学的分裂提出疑问。整个经济学界逐渐认识到宏观经济行为必须和作为它的基础的微观经济原理联系在一起；经济学应该是一套，而不是两套。”^① 连经济学家琼·罗宾逊也认为“把经济学人为地分为微观经济学和宏观经济学是经济学发展的不幸。”^② 目前，西方大多数经济学家都认识到应当将微观经济学与宏观经济学有机地结合起来，宏观经济学只有具有了可靠的微观基础，其理论逻辑才是完整的。所以，在 20 世纪 80 年代以后，西方经济学界兴起了一股宏观经济学的微观基础的研究热潮。新凯恩斯主义者用“菜单成本”和“交叠合同”来解释粘性价格，将宏观价格水平的探索置于微观主体行为安排上。理性预期学派更是深入，不仅从微观经济学的市场出清假设来解释宏观就业、价格变量，甚至还将宏观经济微观化的分析深入到个人理性和信息基础上，提出了独特的真实经

① [美] 约瑟夫·斯蒂格利茨：《经济学》，中国经济出版社 1991 年版，第 17 页。

② [美] 琼·罗宾逊、伊特韦尔：《现代经济学导论》，商务印书馆 1981 年版，第 21 页。