

姜志德 主编

MACROECONOMICS

宏观
经济学

M

西北农林科技大学出版社

宏观经济学

主 编	姜志德	
副主编	宋振英	陆 迁
编 委	王成义	常国庆
	姜雅莉	同海梅

西北农林科技大学出版社

图书在版编目 (CIP) 数据

宏观经济学/姜志德主编. - 杨凌: 西北农林科技大学出版社,
2003.9

ISBN 7-81092-066-9

I. 宏… II. 姜… III. 宏观经济学 IV. F015

中国版本图书馆 CIP 数据核字 (2003) 第 078932 号

出 版	西北农林科技大学出版社
地 址	陕西杨凌杨武路 3 号 邮 编: 712100
电 话	总编室: 7093105 发行部: 7093302
印 刷	国营五二三厂
开 本	787×960 1/16
印 张	19.75
字 数	340 千字
版 次	2003 年 9 月第 1 次
印 次	2003 年 9 月第 1 次印刷
电子邮箱	press0809@163.com

ISBN7-81092-066-9/F·4 定价: 23.60 元

本书如有印装质量问题, 请与本社联系

前 言

西方经济学是财经理类专业重要的专业基础课程之一,目前在全国各大院校普遍开设。然而,由于历史的原因,这门课程一直没有得到足够的重视,表现为课程定位不明确,计划课时偏少,教学环节不配套,授课内容缺乏应有的深度和广度等。长期以来,在人们的头脑中始终摆脱不了一个误区,那就是将西方经济学仅仅看做是与政治经济学不相容的一门参照性课程,它在大学课程体系中似乎只能处于从属地位——此所谓喧宾不可夺主。然而我们在现实中看到的情况却是,经济社会越来越离不开西方经济学的指导,西方经济学的思想、理论、方法和模型已经渗透到从理论至实践的各个角落。这种情况也反过来让我们清楚地认识到课程教学的差距与不足:社会发展要求学生具有全面系统而扎实的经济学基本知识与技能,而课程给予学生的东西却显得那样的单薄。在我国社会主义市场经济制度基本确立,全球经济活动越来越趋向于一体化的新背景下,进一步明确西方经济学在财经理类专业课程中的独立地位,让其在建立学生知识结构中发挥主导作用,并使该课程早日与国际接轨,是目前课程建设的当务之急。

教材建设是课程改革的中心环节。现有教材大都沿袭的是上个世纪八十年代的编写模式,教材的重点在于“引进”和“介绍”,因而内容较为简单浅显,最普遍的特点是篇幅较小,集宏观与微观部分于一册。由于容量有限,就难以对关键的理论模型展开深入的论述,往往是结论多而阐释和论证少,文字说明多而数学推演少,理论思辨多而结合实际少。学生读后往往印象不深,知其然而不知其所以然,应用分析能力就更谈不上。本教材的编写固然是出于配合课程改革的需要,同时也是为克服上述弊端而进行的一种尝试。我们将西方经济学的主要任务分述于微观与宏观两本独立的教材之中,这样就可有足够的篇幅来较为详细地展示各章节的相应内容。

本书即《宏观经济学》共分10章33节,涵盖了本科阶段宏观经济学课程教学的基本要求。与过去的同类教材相比,除了加大容量之外,本书特意增加了对重点问题的详细论证说明,对图表、公式的恰当运用大大提高了经济模型的说服力。为了帮助读者加深对基本知识的理解,还在书中适时的穿插了一定的实证

案例和统计数据。在每章末尾,我们精心选配了相应的思考与练习题,供学生课后复习之用。

参加本书编写的人员及分工为:姜志德,第一、六、十章;宋振英,第四、五章;陆迁,第八章;王成义,第三章;常国庆,第九章;姜雅莉,第七章;同海梅,第二章。由姜志德同志负责本书的大纲拟就和人员组织工作并总纂全稿。以上人员均为本门课程任教多年的一线教师,有较为丰富的教学经验,对课程体系和教材内容有较强的驾驭能力。

在本书的编写过程中,我们参考了大量国内外知名教科书和专著,并择其要目增列于书末。在此,谨向有关作者致以最真诚的谢意!

为了使这本书尽可能完善一些,大半年以来所有参编人员在承担繁重的教学和科研任务之余,牺牲了诸多休息时间,终于使本书得以及早问世。感谢西北农林科技大学出版社以及印刷厂的同志们,仰仗他们的辛勤工作,一些不应有的疏漏才得以避免。尽管如此,由于编者业务水平有限,加上时间仓促,书中缺点和不足之处在所难免,恳请广大读者批评指正。

编 者

2003 年 7 月

目 录

第一章 导 论	(1)
第一节 宏观经济学的研究对象与方法	(1)
第二节 古典宏观经济思想	(8)
第三节 现代宏观经济学的形成与发展	(15)
思考与练习题	(24)
第二章 宏观经济总量及衡量	(25)
第一节 国内生产总值及其衡量	(25)
第二节 国民收入循环及恒等关系	(34)
第三节 物价及就业水平的衡量	(42)
思考与练习题	(50)
第三章 简单凯恩斯模型	(52)
第一节 消费函数与储蓄函数	(52)
第二节 投资函数	(59)
第三节 国民收入的决定	(66)
第四节 国民收入的变动	(78)
思考与练习题	(85)
第四章 IS - LM 模型	(87)
第一节 产品市场的均衡:IS 曲线	(87)
第二节 货币市场的均衡:LM 曲线	(94)
第三节 产品市场与货币市场的同时均衡	(104)
思考与练习题	(116)
第五章 总需求总供给模型	(119)
第一节 总需求曲线	(119)
第二节 总供给曲线	(125)
第三节 总需求总供给模型	(143)

第四节 理性预期学派的总供给曲线	(149)
思考与练习题	(156)
第六章 经济周期理论	(158)
第一节 经济周期及其形成原因	(158)
第二节 卡尔多经济周期模型	(167)
第三节 乘数—加速数模型	(174)
思考与练习题	(181)
第七章 通货膨胀理论	(182)
第一节 通货膨胀的形成及后果	(182)
第二节 通货膨胀与失业的关系	(191)
第三节 通货膨胀动态模型	(197)
思考与练习题	(208)
第八章 经济增长理论	(209)
第一节 经济增长因素的分析	(209)
第二节 经济增长模型	(215)
第三节 经济增长理论的深化	(229)
思考与练习题	(240)
第九章 宏观经济政策	(242)
第一节 财政政策	(242)
第二节 货币政策	(254)
第三节 供给管理政策	(267)
第四节 宏观经济政策的实施	(270)
思考与练习题	(276)
第十章 开放经济理论	(278)
第一节 国际收支与汇率	(278)
第二节 对外贸易与开放经济均衡	(287)
第三节 资本流动与开放经济均衡	(297)
思考与练习题	(304)
主要参考书目	(306)

第一章 导 论

第一节 宏观经济学的研究对象与方法

一、宏观经济学的研究对象

宏观经济学(macroeconomics)这个术语,一般认为是由挪威著名经济学家、首届诺贝尔经济学奖获得者之一费里希(R. Frisch)在1933年提出来的。从字义上看,macroeconomics是由macro和economics两个部分构成。顾名思义,宏观经济学就是研究“大”问题,即研究整个国民经济活动或宏观经济现象的经济学。一般认为现代宏观经济学出现于20世纪30年代,1936年,英国经济学家凯恩斯的《就业、利息与货币通论》(以后简称《通论》)一书的出版,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。

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及其增长、通货膨胀率与失业率、国际收支和汇率等。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。

宏观经济学研究的重点内容包括消费、投资、货币的供求、工资和物价的变动、银行制度及货币政策、财政预算及财政政策、贸易差额、汇率及利率等有关宏观经济问题和经济政策等。

宏观经济学和微观经济学之间的根本区别体现为研究对象和阐述方法上的差别。研究单个商品及要素价格的决定及其变化是微观经济学的任务,而宏观经济学则致力于探讨价格总水平(通货膨胀和通货紧缩)的决定及其变化。再如,微观经济学研究单个企业最佳劳动力需求及其最佳产量,而宏观经济学则讨论就业及国内生产总值的决定等等。

即便是研究相同问题,它们在研究方法上还是有所差别。在研究单个行业的价格决定时,微观经济学家总是要假定其他行业的价格是给定的;在宏观经济学中,我们研究平均价格水平,通常合理地忽略不同行业之间的商品相对价格的变化。在微观经济学中,需要假定所有消费者的收入是给定的,然后探讨消费者如何将他们的收入分配在不同商品的购买支出之上;相反,在宏观经济学中,收入或支出的总水平却是被研究的关键变量。

既然宏观经济学以整个国民经济活动作为研究对象,它必然就要分析与整个国民经济活动有关的国内生产总值、国内生产净值、国民收入以及相关的经济总量的变动。进一步地说,以整个国民经济活动作为研究对象的宏观经济学,必然要考察诸如社会总收入、总支出、总消费、总投资、总储蓄、经济周期与波动、失业率、物价水平、通货膨胀以及它们之间的关系等问题。以单个经济单位为研究对象的微观经济学则一般不去分析上述这些与整个国民经济活动有关的问题。

宏观经济学在考察总投资、总储蓄、经济周期与波动、物价水平、通货膨胀等问题时,要涉及整个国民经济中的货币和财政收支的变动。在货币方面,一国的货币流通数量、货币流通速度、利率水平、银行存款总额、银行贷款总额,以及它们与国民收入变动的关系,都成为宏观经济学的研究内容。在财政方面,一国的财政预决算、财政盈余和财政赤字、税收总额、公债发行总额,以及它们与国民收入变动的关系,也都成为宏观经济学的研究内容。而这些同样是微观经济学不去考察的。

在现代经济学中,经济增长以国内生产总值(或国民生产净值,国民收入)的增长来表示,而经济增长的实现与投资总量的增长、人口和就业人数的增长,技术进步等有密切的联系。因此,宏观经济学也把经济增长作为自己的研究内容。

根据以上所述,可以对宏观经济学的对象做这样的表述:宏观经济学以整个国民经济活动作为研究对象,即以国内生产总值、国内生产净值和国民收入的变动及其与就业、经济周期波动、通货膨胀、财政与金融、经济增长等等之间的关系作为研究对象。宏观经济学一般包括国民收入均衡理论、就业理论、经济周期理论、通货膨胀理论、财政与金融理论、经济增长理论等。

二、宏观经济学的学科体系

宏观经济理论是宏观经济学的基础与核心,它是对宏观经济现实的抽象分析,其目的就是通过对各种宏观经济总量之间关系的分析来探讨整个经济运行的规律,从而回答一系列重大宏观经济问题。

宏观经济理论以国民收入(即国内生产总值)的决定为中心来展开对各种宏观经济问题的分析,以探讨整个经济的运行规律,研究各种总量之间的相互关系,并为经济政策提供理论依据。宏观经济学学科体系主要包括以下几个方面:

1. 国民收入决定理论

说明国民收入(即国内生产总值或总产量)与价格水平的决定。这一部分是宏观经济理论的中心,因为其他宏观经济问题都是用这一理论来解释的。具体来说,国民收入的大小决定了就业(或失业)的状况,就业理论也就是国民收入决定理论的运用,价格水平决定了通货膨胀的状况,各种通货膨胀理论也是由

价格决定引申而来的,经济周期是国民收入的周期性波动,经济增长是国民收入的长期增长趋势,而开放经济理论则是分析在存在着各国经济往来的情况下,国民收入与价格水平的决定以及相关的问题。

对国民收入决定的分析一般采用总需求分析和总需求—总供给分析方法。总需求分析是在假定总供给和价格水平不变的情况下,分析总需求如何决定国民收入水平,它又可以分为简单国民收入决定模型和 IS—LM 模型。总需求—总供给分析是把总需求与总供给结合在一起分析国民收入与价格水平的决定,也称为总需求—总供给模型。

(1)简单的国民收入决定模型,又称简单凯恩斯主义国民收入决定模型。这一模型是要在严格假设和高度抽象的前提下说明总需求决定的基本原理。它假设总供给、价格水平、投资与利率都不变,说明在两部门与三部门经济中总需求如何决定国民收入的变动方向、调整过程以及数量大小。这一模型看似“简单”,但却说明了总需求决定论的一些重要思想,是整个国民收入决定理论的出发点。

(2)IS—LM 模型是对简单国民收入决定模型的扩大。它说明消费、投资、利率对国民收入决定的影响,从更广泛更现实的角度说明了总需求如何决定国民收入。这一模型不仅分析了在国民收入决定中消费、投资、货币需求与供给、利率等因素的关系,而且可用于分析财政政策与货币政策。因此,这一模型被称为宏观经济学的核心。围绕这一模型将展开宏观经济学中的四个重要方面的理论:消费函数理论、投资理论、货币需求理论与货币供给理论。

(3)总需求—总供给模型是用总需求与总供给的相互作用来说明国民收入与价格水平的决定。它首先分析不同情况下总供给的特点,决定总供给的各种因素,以及总供给的变动,然后把总需求与总供给结合在一起,构成总需求—总供给模型。其他相关理论都是在这一基础之上展开的。

2. 失业与通货膨胀理论

运用国民收入决定理论来分析失业与通货膨胀这两个最令人关注的宏观经济问题。这里包括这样三个部分:

(1)失业理论

失业可以分为总需求不足所引起的周期性失业与经济中难以避免的自然失业。失业理论的主要任务就是要分析造成这两种失业的原因。对失业原因的不同解释就构成不同的失业理论,形成针对失业的不同政策依据。

(2)通货膨胀理论

通货膨胀也许是宏观经济学中争议最大的问题,甚至连对通货膨胀的定义都没有达成一致的到意见,对于通货膨胀的原因方面的争论就更大了。各种通货膨胀理论从不同的角度分析通货膨胀的原因,这些不同的理论实际上不应该

看做是相互对立与排斥的,而应该看做是互相补充的。这些理论也都是围绕总需求、总供给,或者影响这两者的因素展开的。

(3) 失业与通货膨胀的关系

凯恩斯主义宏观经济理论认为当存在失业时不会引起通货膨胀,只有在实现了充分就业之后过度总需求的存在才会引起通货膨胀。但这种理论与战后的现实并不相符。这样就提出了著名的菲利普斯曲线。该曲线认为,失业与通货膨胀之间存在此长彼消的交替关系。然而,70年代初失业与通货膨胀并存的事实又对这一理论提出了挑战,于是,经济学家又通过对菲利普斯曲线的发展和改进来解释滞胀现象。

3. 经济周期理论

经济活动的周期性的波动一直是经济学家所关注的问题。在凯恩斯主义出现之前就形成了各种不同的经济周期理论,但这些理论与现代宏观经济学中的经济周期理论并不相同。现代经济周期理论主要以凯恩斯主义的总需求分析为中心,从影响总需求的各种因素中寻找引起经济活动周期性波动的原因。近年来,各种非凯恩斯主义经济周期理论也有许多相当重要的发展。

4. 经济增长理论

经济增长同样是经济学的一个古老话题。即使在当今时代,经济学家也在从不同的角度,用不同的方法来研究经济增长问题。库兹涅茨等人整理分析各国经济增长的资料,重点研究经济增长与制度的关系;美国经济学家罗斯托(W. Rostow)从历史发展的角度提出了“成长阶段论”;各流派经济学家建立了不同的经济增长模型,以及对影响经济增长的因素的定量分析;罗马俱乐部的经济学家研究对经济增长的各种限制,提出了“增长极限论”等等。这些都属于经济增长理论,并构成了一门相对独立的分支学科“增长经济学”。从宏观经济学的角度来看,经济增长是总供给的长期增加,研究经济增长的中心是分析影响总供给增加,即经济增长的各种因素,及它们之间的相互关系。

5. 开放经济理论

各国间存在着日益密切的经济联系,这些联系对一国国内经济活动情况影响甚大。开放经济理论就是研究各国物品、资本的流动对一国经济的影响,也就是在开放经济的条件下研究上述四个宏观经济理论,进而说明开放经济中国民收入的调节。

6. 宏观经济政策

宏观经济学的最终目的在于为国家干预经济出谋划策,因此,宏观经济政策在宏观经济学中占有十分重要的地位。当今各国的经济学家日益重视对政策问题的研究,并越来越多的参与政策的制定。宏观经济政策业已发展为一门宏观经济政策学。当然,宏观经济理论与政策是紧密相关的,理论是政策的依据,政

策是理论的运用。但宏观经济政策也有自己研究的特定问题,它们包括政策目标、政策工具、政策机制、政策效应,以及各派对政策问题的不同看法。

三、宏观经济学的研究方法

宏观经济学最基本的研究方法是普遍采取总量分析方法。这种分析方法也称宏观经济分析方法,是数量分析方法的一种,它适合于研究经济总量之间的关系。宏观经济学在进行考察时,首先假定制度是已知的和既定的,然后在这个已知的、既定的制度前提下对经济总量进行分析。这并不是说宏观经济学否认制度因素在经济中的作用,或认为制度的变动对于经济的变动是不重要的。宏观经济学只是认为,不管制度因素是否重要,也不管制度变动可能对经济变动产生何种程度的影响,但制度本身或制度变动的原因和后果都不是宏观经济分析范围以内的问题,在分析总量时可以把这些当作既定的条件,不予讨论。

宏观经济学在进行总量分析时,通常也把个量当作已知的、既定的前提,即假定个量不变。例如在研究物价问题时,宏观经济学研究整个社会物价水平的变动,研究物价水平的变动对国民收入的影响,研究物价水平变动与社会失业率的变动关系等等。这些都属于总量分析的范围。至于单个商品的价格是如何确定的,个别商品价格的升降对该种商品的供求以及对另一种商品的价格可能有什么影响等等,这些都是微观经济学所要研究的;宏观经济学在考察物价水平变动时,把这些当作既定的条件,不予分析。再以对消费的研究为例,宏观经济学对总消费与总收入的关系、总消费与总投资的关系进行考察,对社会的消费支出趋势进行研究。至于单个消费者的消费行为是如何决定的,单个消费品价格的升降对消费者家庭支出的影响如何,这些也是微观经济学的研究课题;宏观经济学在对消费进行总量分析时,假定上述这些是已知的、既定的,从而不予分析。

宏观经济学在采用总量分析方法进行分析时,可以采取静态的、比较静态的或动态的分析方法。静态宏观经济分析就是分析宏观经济现象的均衡状态以及有关的经济总量达到均衡状态所需要具备的条件。比较静态宏观经济分析就是分析在已知条件发生变化以后宏观经济现象均衡状态的相应变化,以及有关的经济总量在达到新的均衡状态时的相应变化。换句话说,比较静态宏观经济分析主要是对宏观经济现象和有关经济总量的一次变动(而不足连续变动)的前后进行比较。无论是静态宏观经济分析还是比较静态宏观经济分析,都不分析从原有的宏观经济现象均衡状态过渡到新的均衡状态的实际变化过程。动态宏观经济分析则对这一实际变化过程进行分析,其中包括分析有关经济总量在一定时间过程中的变动,这些经济总量在变动过程中的相互影响和彼此制约的关系,以及它们在每一时点上变动的速率等等。凯恩斯在《通论》一书中采取的主要是比较静态宏观经济分析方法。例如在讨论社会对消费品的需求将随着国民

收入的增加而增加时,凯恩斯主要是把两种静态宏观经济现象进行比较,即比较由于国民收入变动而产生的前后两个不同总量的消费需求,而不是分析社会对消费品需求的变化过程。该分析没有说明前一时期的收入、本期的收入和本期的消费之间是如何制约的,也不研究收入和消费在每一时点上变动的速率。凯恩斯以后发展起来的经济增长分析,以及瑞典学派一些经济学家在把经济变量区分为“事前的”和“事后的”两类情形时所作的过程分析或期间分析,则都属于动态宏观经济分析之列。它们都考察了时间因素的影响,并把宏观经济现象的变化当作一个连续的过程来看待。

宏观经济学在分析总需求与总供给的均衡关系时,可以着重从需求的方面进行分析,也可以从需求和供给两个方面来进行分析。凯恩斯在《通论》一书中采取的是需求分析的方法。他所考察的是短期现象,因此除了假定社会结构不变之外,还假定劳动力人数、劳动者技巧、现有资本设备的数量和质量、现有生产技术、市场竞争程度等等供给方面的因素也是不变的。凯恩斯从需求分析出发,考察国民收入的变动与投资总量、消费总量变动之间的关系,得出了调节总需求以稳定经济的所谓“需求管理”的主张。凯恩斯的追随者们在宏观经济分析中对凯恩斯的需求分析方法作了补充和发展,即在进行需求分析的同时,还分析了供给。例如,英国经济学家哈罗德和美国经济学家多马在其经济增长论中认为凯恩斯只注意到投资在增加需求方面的作用,而没有注意到投资在供给方面的作用,即投资也意味着产生新生产能力。哈罗德和多马指出,由于投资既创造需求,又扩大生产能力,所以本期均衡时的投资为下期均衡带来了新增产品的实现问题,否则扩大的生产能力得不到利用,投资将会减少。因此,要使下期也能达到新的均衡,使新增生产能力得到利用,投资应比前一时期有更大幅度的增加。而从20世纪70年代开始,由于世界能源供给和原料供给问题日益突出,宏观经济分析中的供给分析的重要性也日益被经济学界所承认和重视。

宏观经济学在以整个国民经济活动作为研究对象时,可以采用流量分析方法,也可以采用存量分析方法。流量分析是指对一定时期内有关经济总量的产出、投入(或收入、支出)的变动及其对于其他有关经济总量的影响进行分析。存量分析是指对一定时点上已有的经济总量的数值及其对于其他有关经济总量的影响进行分析。凯恩斯在《通论》中进行总量分析时,虽然也对存货数量,银行存款总额等存量的变动作了分析,但他主要是分析收入的流量。一定时期内的总收入、总投资、总消费、总储蓄的变动及其造成的影响,是凯恩斯主义宏观经济学考察的重点。与存量分析相比,流量分析不仅在研究社会就业问题时有着更为深远的意义,而且在统计学上也显得困难较小。但就宏观经济学所要研究的整个国民经济活动而言,仅有流量分析无疑是不够的。这就是凯恩斯以后的一些西方经济学家在进行总量分析时,不断加强存量分析的原因之所在。例如,

在研究经济周期性波动和经济增长时,他们不仅分析一定时期的投资和消费,而且还要分析一定时点上的资本存量和消费品存量,因为后者对于经济周期波动和经济增长同样起着重要的作用。在研究一国经济发展程度和居民生活水平时,不仅要分析国民收入和国民收入增长率,而且还要分析国民财富和国民财富增长率。宏观经济学越来越强调采用存量分析方法,使之与流量分析方法并重,并且着手从统计学上来解决存量统计中的问题,这是当前宏观经济学研究方法上的又一个明显的发展趋势。

宏观经济学在以整个国民经济活动作为研究对象,进行总量分析时,可以采用实证分析方法,也可以采用规范分析方法。实证方法说明“是什么”的问题,规范方法说明“应该是什么”的问题。当有关的经济总量变动时,实证方法分析这些总量的变动将会引起什么样的反应,造成什么样的后果;规范方法分析这些总量变动所引起的反应和造成的后果是否符合某种伦理标准,从而提出应当如何调控这些总量变动的反应和后果以期达到人们预定的伦理标准。凯恩斯在《通论》一书中大部分章节采用的是实证分析方法,即力图说明国民收入的变动将在就业和物价方面引起的反应和造成的后果。凯恩斯以后的宏观经济学者们,也都以实证分析方法为主,而把经济行为(包括经济政策)的评价标准和选择原则视为并非宏观经济学所要探讨的课题。然而,从20世纪70年代起,特别是近些年来,宏观经济学中的规范分析日益受到重视。

宏观经济学普遍采用的另一类研究方法是宏观经济计量模型。宏观经济计量模型是用以反映宏观经济总量行为的一组数量方程式,这些总量包括国内生产总值、国民收入、消费、投资、政府支出、就业、物价水平、利率、国际收支与汇率等。宏观经济计量模型的方法论包括模型的建立、估算、检验与分析,以及运用模型进行预测等问题。

宏观经济计量模型有两种类型:一种是理论模型(theoretical models),另一种是经验模型(empirical models)。理论模型是用数学模型来表述已有的经济理论,即完全按理论本身来建立模型,传统的作法是根据理论来选择模型所要解释与估算的变量。在许多情况下,理论也表明了所要解释的变量之间的相关性,理论模型正是以理论为指导来建立,并根据经验资料来确定变量的具体形式。经验模型是根据对经验事实的观察研究来建立模型,并在建立模型的过程中形成新的理论。建立经验模型比建立理论模型要困难得多,其中最主要的困难之一就是受到所得资料的数量与质量的限制。此外,在经验模型中假设更为重要,其中特别是关于预期形成的假设,在大多数经验模型中预期的未来值都起着重要的作用。由于预期值一般是无法观察到的,所以在形成经验模型时就要对预期的形成做出某种假设。一般采用的是适应性预期假设,所以就用过去与现期值的加权平均数作为预期值,当然目前也有人对这种预期形成方法提出了批评。

一旦做出了假设,使模型中出现的是可以观察到的变量,就可以对模型进行估算了。

无论哪一种模型都涉及各种变量,在建立模型时一般把变量分为内生变量(endogenous variables)与外生变量(exogenous variables)。内生变量是其数值需在模型之内决定的变量,它的变化是模型内其他变量变动的结果;外生变量是其数值需在模型之外决定的变量,它的变化是模型以外的因素决定的,在建立模型时可以假设其固定不变。外生变量影响内生变量,但建立模型的目标却是要表明内生变量的决定,这也就是说,内生变量是因变量,而外生变量是自变量。

宏观经济计量模型的方程式有两类:一类是定义方程式(definitional equations),又称恒等式,代表国民收入核算中的恒等关系,这类方程式不能用来解释经济变量的行为,没有未知的参数需要计量,它们在模型中的作用是提供计算资料,以便使整个方程体系完整可解;另一类是行为方程式(behavioural equations),用来解释经济变量的行动,说明各种经济变量之间的相互关系与影响,以及经济变量的决定,这类方程式是模型的主要构成部分。但是,经济计量模型不同于数学模型,经济计量模型要求能与实际统计资料相结合。因此,行为方程式就要包括随机误差项。

现代数学与计算技术的进展为宏观经济计量模型的实际运用,尤其是在政策制定中的运用创造了有利的条件。正因为这样,宏观经济计量模型得到了广泛的重视。理性预期学派的出现对宏观经济计量模型的发展更有重大的影响,它使模型更加复杂,也更加接近于现实。但如何使宏观经济模型符合实际,并能成功地运用于经济预测和政策制定等方面,仍然需要经济学家们做出更多的努力。

第二节 古典宏观经济思想

经济学作为一门独立的学科是在资本主义生产方式确立之后出现的,作为经济学一个组成部分的宏观经济学的形成也应该是在经济学产生之后的事情,在此之前有关宏观经济问题的分析与其他经济思想一样充其量是一些支离破碎的观点,远远不能称其为一门系统的学科。一般而言,现代西方经济学的源头是古典经济学,因此,我们对宏观经济历史考察将从古典经济学开始。在学术界,古典经济学有三种不同的含义。第一种是指从17世纪中期到19世纪70年代之前的经济学,即本书所采用的含义。第二种指从17世纪中期到20世纪30年代之前的经济学,包括本书中所说的古典经济学与新古典经济学。这两种含义是西方经济学中所采用的。第三种含义是马克思主义经济学中的用法,指17世纪中期到19世纪初期的资产阶级经济学家。具体来说,在英国是从威廉·配

第到大卫·李嘉图,在法国是李从布阿吉尔贝尔到西斯蒙第。马克思称他们为古典经济学是肯定了他们经济学中合理的内容。

本节拟采用上述第二种含义,并且将之分为两个阶段,对古典经济学的宏观经济思想加以简要回顾。

一、19 世纪 70 年代之前的古典宏观经济思想

在古典经济学中,无论是英国古典经济学家还是法国重农学派,都对宏观经济的研究做出了重要的贡献。美国经济学家熊彼特(J. Schumpeter)在其著名的《经济分析史》一书中指出,经济分析史中有一条重要的线索:配第一坎蒂隆—魁奈。坎蒂隆的思想来源于配第,而魁奈的思想又来自于坎蒂隆。这也就是古典经济学中宏观经济分析形成的线索。在此之后则是斯密、李嘉图、萨伊等人的发展。

威廉·配第(William Petty)是公认的政治经济学创始人,他在 1662 年出版的《赋税论》被认为是西方经济学中第一部以宏观经济为考察对象的著作。他的《政治算术》、《献给英明人士》等著作都涉及国民财富增长、货币、财政等宏观问题。理查德·坎蒂隆(R. Cantillon)是爱尔兰经济学家,主要著作为《商业性质概论》。英国经济思想史专家埃里克·罗尔(Eric Roll)称这本书“是《国富论》出版以前关于经济原理的最系统的著作”。该书第一部分论述以物质财富生产为基础的社会经济的扩大,第二部分论述货币等问题,第三部分论述对外贸易。坎蒂隆在该书中分析了财富的性质、生产方法,财富在各阶层间的流通、分配,以及物价、货币、信用、银行、外贸等问题。特别是关于土地及地主的支出与国民经济生活的关系的论述被认为是“重农主义理论的萌芽”,也可以说是魁奈《经济表》的基础。法国重农学派经济学家魁奈(F. Quesnay)的《经济表》是古典式总量分析的典范。他从宏观的角度分析了社会总资本的再生产和流通过程,是第一个从社会总资本出发来分析社会再生产过程的经济学家。他把整个社会成员划分为三个阶级,即生产阶级、土地所有者阶级、不生产阶级,采取固定价格,考察“年预付”(流动资本)、“原预付”(固定资本)、“纯产品”(剩余价值)三个经济总量之间的关系。这实际上是对一定时期内社会商品流通总量和货币流通总量,对社会总产品和总收入,以及对社会生产两大部分(工业和农业)之间的交换关系作了宏观静态的分析。因此,西方经济学界有人把魁奈称做凯恩斯式宏观经济学的先驱。

魁奈之后,杜尔阁(A. R. J. Turgot)也考察了资本主义社会各阶级的收入及其与总收入变动之间的关系。杜尔阁还对社会总资本及其各个组成部分的运动,一国总财富的计算、利息率水平对国民储蓄和投资(尤其是对土地的投资)的作用进行了考察。这些都应当看做是杜尔阁在考察整个国民经济活动方面的

成就。

亚当·斯密(Adam Smith)的《国富论》,在更广泛的领域内探讨了国民财富的形成和增长问题。尤其是在该书第二篇“论资财的性质及其积累和用途”和第五篇“论君主或国家的收入”中,亚当·斯密既分析了整个社会的总资财、全体国民的资财的积累和增殖,又分析了个人收入之和与国民纳税能力之间的关系,以及后者同政府收入与支出之间的关系。他在有关国民财富的研究中得出了这样的结论:国民实际财富的大小并不取决于其总收入的大小,而取决于其纯收入的大小。亚当·斯密所进行的这些总量分析,受到了后来的经济学家的重视。

大卫·李嘉图(D. Ricardo)也考察了国民财富增长问题、总收入与纯收入问题,他对于货币流通量变动与物价水平变动之间关系的论述是特别值得注意的。李嘉图作为当时英国经济学界通货学派的主要代表人物,认为缺少无限兑现条件的银行券的过度发行会造成银行券贬值,从而引起物价上涨和英镑汇价下跌。这个问题正是宏观经济学所要考察的重要课题之一。

在法国,布阿吉贝尔(P. Boisquillebert)从税收和物价水平的角度对国民经济进行了探讨。他在17世纪末和18世纪初所著《法兰西的详情》、《谷物论》、《论财富、货币、租税的性质》等著作中,指出国民消费支出的不足与国家财政收入减少之间存在着依存关系,并认为一国收入的增长与消费的增加成正比例,而与金银铸币数量的增加没有直接联系。

法国经济学家萨伊(J. B. Say)在《政治经济学概论》第十五章中论述了“供给创造它自己的需求”这一经济学中著名的“萨伊定理”。这一定理包括四点含义:(1)一种产品的生产给另一种产品创造了需求;(2)货币交换的实质是产品与产品之间的交换;(3)某种产品过剩是因为另一种产品供给不足,所以造成生产过剩的原因是供给不足;(4)局部的产品失调可以通过价格来调节。由以上的观点又可引出了四个结论:第一,在一切社会中,生产者越多,产品越多样化,产品需求的增加便会越快、越多和越广泛,而且生产者得到的利润就越多,因为价格随需求而上升,这就是供给决定需求;第二,每一个人都与全体成员的共同繁荣有利害关系,一个企业办得成功,就可以帮助别的企业也达到成功,这就是说个人对私利的追求,可以同时实现社会的公益;第三,购买和输入外国的货物决不至于损害国内或本国的产业和生产,也就是主张自由贸易;第四,鼓励生产是贤明的政策,鼓励消费是拙劣的政策,也就是主张以发展生产来实现经济的发展。

对于萨伊定理,各个时期的经济学家曾经有过许多评论。从宏观经济学发展的角度来看,萨伊定理对凯恩斯主义之前的宏观经济思想影响甚大。首先,萨伊定理强调了总供给的决定作用,这是凯恩斯主义之前宏观经济思想的传统。