

宏观经济学

孙斌艺 著

上海人民出版社

014031052

F015
197

宏观经济学

孙斌艺 著



上海人民出版社



北航

C1718891

F015
197

图书在版编目(CIP)数据

宏观经济学/孙斌艺著. —上海: 上海人民出版社, 2014

ISBN 978 - 7 - 208 - 11928 - 4

I. ①宏… II. ①孙… III. ①宏观经济学—教材
IV. ①F015

中国版本图书馆 CIP 数据核字(2013)第 276350 号

责任编辑 周 峥

封面设计 陈 楠

宏观经济学

孙斌艺 著

世纪出版集团

上海人民出版社出版

(200001 上海福建中路 193 号 www.ewen.cc)

世纪出版集团发行中心发行

上海商务联西印刷有限公司印刷

开本 720 × 1000 1/16 印张 17.5 插页 2 字数 310,000

2014 年 2 月第 1 版 2014 年 2 月第 1 次印刷

ISBN 978 - 7 - 208 - 11928 - 4/F · 2201

定价 35.00 元

前言

量入为出对于保证一个家庭正常的、可持续的生存是非常重要的,可是对于政府支出人们在刹那间变换为另一种思路:赤字财政可以使国民收入多倍增加,政府支出少量增加可以使国民收入多倍增加,从而提高人们的整体生活水平。如果从单个人或家庭角度而言是不合理的、寅吃卯粮的决策,那么从整个国民经济的角度看不可能是合理的。但是,就是这样一个简单的逻辑在经济分析中经常被有意无意地忽视,从而出台大量的看上去有道理但实质伤害整个经济的政策。

典型的就是在经济衰退时期利用政府支出来增加需求的理论谬误。当政府支出增加后,确实会增加总需求,那么由于支出的乘数效应,会带来国民收入的多倍增加。这是我们从政府支出中能够看得到的直接效应,但是人们往往忘记了政府支出的间接效应。也就是说,政府支出的资金来源,不管其来源于何处,其融资来源最终会归于税收或隐性的税收。那么,为增加政府支出必须增加税收,而税收会对人们的消费需求、企业的投资需求产生抑制,经过乘数效应的作用,会带来国民收入多倍减少。假定政府支出的效率与私人消费和投资支出的效率是相同的,那么利用政府支出所增加的总需求充其量与税收导致的总需求减少量正好相抵,不会产生增加总需求的净效应。

考虑到以下几种情况,政府支出的净效应一定是负的。其一,政府支出的效率必然低于私人支出。众所周知,为别人花别人的钱是多么的漫不经心,我们可以寄希望于圣人解决这个问题,但核心问题在于圣人太少了,不足以解决大范围的政府支出决策问题。这会造成第一种损失,这是一种效率损失,社会资源被用于缺乏效率的用途,从而导致整个社会总产品和劳务的总量净下降。

其二,劳动力资源过多配置于政府部门造成的浪费和效率损失。一旦由政府执行的各种支出项目增加,必须在政府部门配置更多的劳动力。相对而言,由于政府部门的工作稳定,竞争压力较弱,同等水平下公务员岗位的吸引力明显大

于私人部门。那么,当这些高于社会平均水平的劳动力配置到政府部门时,我们运用这些劳动力可能生产出来的产品和劳务便没有了,同时还要耗费大量的资源养活多出来的公务员,不啻为社会增加的一大负担。这是非公共物品政府支出的第二种损失。

其三,外在监管的低效率。当我们增加政府支出时,无法利用私人投资内在的激励机制,无法有效地运用内在激励避免错误、提高投资效率,那么就需要叠床架屋地设计各种监管机制,但是其中的一个重大问题在于:谁来监管监管部门?这样势必造成严重的低效率问题,最终导致社会的又一重损失。这是第三种损失。

上述分析均是宏观经济学这门课程要涉及的核心内容,就宏观经济学来说,这种现象或问题比比皆是,凯恩斯主义理论的隐含前提在于我们对于经济现象了如指掌,我们可以取政策之利,而不会受到政策带来的消极后果的影响。事实上,我们对经济现象的理解可谓刚刚入门,所以仔细权衡政策之短期和长期效应、直接和间接效应才是正确的道路,也是学习宏观经济学应当严肃对待的。因此,如果要真正理解各种经济现象的直接和间接、短期和长期效果,就必须掌握现有的经济学基本理论,在此基础上深入观察,小心求证,才能使我们更好地理解经济社会的内在运作机理,行为处事也才能更加客观理性。

本书是经济学教材的其中一部,讲述的是宏观经济学,描述和分析似乎离我们生活很远但又时时左右着我们的涉及国民经济总体的宏观问题。为便于学生理解和学习,本书按照宏观经济学的基本逻辑体系进行写作。我个人将宏观经济学归纳为五个词、十个字,即“核算、决定、变动、问题和政策”。其中,“核算”是指国民收入核算,这部分内容可以视为宏观经济学的预备知识,主要说明衡量宏观经济总量的基本方法,以及各个经济总量之间的基本核算关系,这些内容构成了本书的第二章。“决定”是指国民收入决定,这是宏观经济学理论的核心部分,是分析各种宏观经济现象和问题的基本理论框架,主要由收入支出模型、产品市场和货币市场同时均衡模型以及总需求和总供给模型构成。本书的第三章到第八章阐述这些理论模型。“变动”是指宏观经济的短期波动和长期变动,短期波动研究经济周期问题,长期变动研究经济增长问题,本书第十一章和第十二章对这些问题进行了分析。“问题”是指宏观经济中存在的两大经济病症,即通货膨胀和失业,这构成了本书的第九章。“政策”是指宏观经济政策,构成本书的第十章。可以毫不夸张地说,宏观经济政策是宏观经济学的落脚点,前面的分析都与它密切相关,是为政策运用提供理论支撑的。

本书写作中考虑到教师实际教学的需要。一般而言,教材难度较高时,教师比较容易取舍,可以根据学生的层次有选择地讲授某些内容。因此,本书采取了

“就高”的写作定位,即整个难度比通常本科生的教学要求高一些,不少地方运用了数学模型推导的方法,以期反映宏观经济学的一些前沿内容,教师在具体讲授过程中可以适当调整,删减一些难度较大的部分。此外,现代信息技术发展越来越快,网络中蕴藏着大量的宏观经济实际信息,教师可以结合相关章节内容,从网络上获取实际资料,将其运用到教学中,这样可以使学生能够更好地将理论与实践联系起来。

虽然老套但还是要说明一下,在本书写作期间,得到华东师范大学商学院众多同事的支持和帮助,同时我的家庭也给予巨大的理解和支持,在此对他们表示由衷的谢意。

本书一定还存在许多错误,恳请读者多提宝贵意见,以便修订再版时改进。我的电子邮件地址是:bysun@dbm.ecnu.edu.cn。

孙斌艺

2013年8月16日

目 录

前言	1
第一章 导论	1
学习目标	1
第一节 宏观经济学涵义	1
一、宏观经济学的研究对象	1
二、宏观经济学的理论体系	2
第二节 宏观经济学的一些基本概念	5
一、国内生产总值	5
二、通货膨胀和通货紧缩	6
三、失业和失业率	9
第三节 学习和研究宏观经济学的意义	10
一、从微观到宏观	10
二、宏观经济学与个人职业生涯发展和企业经营管理	11
习题一	11
第二章 国民收入核算	13
学习目标	13
第一节 国内生产总值	13
一、国内生产总值的定义	13
二、名义 GDP 和实际 GDP	14
三、最终产品和中间产品	18
四、存量和流量	19
五、当前生产和销售	20

六、国内生产总值和国民生产总值	21
七、市场活动与非市场活动	21
八、国内生产总值指标存在的若干问题	22
第二节 国内生产总值核算的基本方法	22
一、总产出、总收入与总支出	22
二、收入法	24
三、支出法	26
第三节 国民经济中的其他主要经济总量指标	30
一、国民生产总值	30
二、国内生产净值	30
三、国民生产净值	31
四、国民收入	31
五、个人收入	31
六、个人可支配收入	31
第四节 国民收入核算中的恒等关系	33
一、两部门经济中的储蓄投资恒等式	33
二、三部门经济中的储蓄投资恒等式	33
三、四部门经济中的储蓄投资恒等式	34
习题二	35
第三章 消费和储蓄理论	37
学习目标	37
第一节 消费和消费函数	38
一、消费支出及其影响因素	38
二、消费函数	40
三、国民消费函数	43
第二节 储蓄和储蓄函数	44
一、储蓄函数	44
二、消费函数和储蓄函数的关系	46
第三节 现代消费理论及其发展	48
一、相对收入假说	48
二、持久收入假说	49
三、生命周期假说	51
习题三	52

第四章 投资理论	54
学习目标	54
第一节 概述	54
一、宏观经济学中的投资概念	54
二、决定投资的主要因素	58
第二节 资本边际效率与投资的决定	59
一、资本的未来收益贴现率与资产的现值	59
二、资本边际效率	63
三、投资函数	67
第三节 投资的加速原理	68
一、资本—产出比率	68
二、加速原理	69
第四节 固定资产投资和存货投资	70
一、固定资产投资的新古典模型	70
二、存货投资	72
习题四	74
第五章 国民收入决定的收入支出模型	76
学习目标	76
第一节 总需求与均衡产出和均衡收入	77
一、国民经济中的总需求	77
二、国民经济的均衡条件	78
第二节 两部门经济的收入支出模型	80
一、消费函数与均衡国民收入	80
二、投资、储蓄和均衡国民收入	81
三、两部门经济中均衡的比较静态分析	82
第三节 乘数理论	83
一、国民收入决定的动态分析	83
二、乘数的含义	85
三、乘数的数学推导和图解	86
第四节 三部门和四部门经济的收入支出模型	88
一、引入政府部门	88
二、三部门经济的收入支出模型	90
三、三部门经济中的乘数	92

四、四部门经济的收入支出模型	96
习题五	99
第六章 货币需求和货币供给	101
学习目标	101
第一节 货币的性质和发展	102
一、货币的性质	102
二、货币的发展	104
三、现代货币层次	106
第二节 银行体系与货币创造	109
一、银行体系	109
二、存款创造与货币供给	110
第三节 货币需求	114
一、货币需求和货币需求动机	114
二、影响货币需求的因素	115
三、货币需求函数	118
第四节 货币市场均衡	121
一、均衡利率的决定	121
二、均衡利率和均衡货币量的变动	122
习题六	123
第七章 扩展的凯恩斯宏观经济模型：IS-LM 模型	124
学习目标	124
第一节 产品市场均衡	125
一、产品市场均衡曲线的推导	125
二、IS 曲线的特征	129
三、产品市场的失衡	132
第二节 货币市场的均衡	133
一、货币市场均衡曲线的推导	133
二、LM 曲线的特征	136
三、货币市场的失衡	137
第三节 产品市场与货币市场的一般均衡	138
一、均衡利率和均衡收入的决定	138
二、市场均衡的比较静态分析	141

三、IS-LM 模型的政策含义	144
习题七	146
第八章 国民收入决定的 AD-AS 模型	148
学习目标	148
第一节 总需求曲线	149
一、总需求曲线的推导	149
二、总需求曲线的特征	152
第二节 总供给曲线	157
一、劳动力市场均衡与总供给	157
二、总供给曲线的推导	161
三、凯恩斯主义总供给函数	165
四、古典学派总供给函数	167
第三节 总供求模型	168
一、古典学派总供求模型	168
二、凯恩斯主义总供求模型	169
三、总供求模型的政策含义	170
习题八	172
第九章 宏观经济的主要问题:通货膨胀和失业	174
学习目标	174
第一节 通货膨胀	175
一、通货膨胀的定义与衡量	175
二、通货膨胀的类型	180
三、通货膨胀的成因	182
四、通货膨胀的成本	188
五、通货膨胀的经济效应	189
六、通货膨胀的治理对策	192
第二节 失业及其对国民经济的影响	194
一、失业及其类型	194
二、失业的成本和奥肯定律	198
三、自然失业率及其决定因素	199
第三节 通货膨胀和失业的替代关系	200
一、菲利普斯曲线	200

二、预期和菲利普斯曲线	202
三、长期菲利普斯曲线	204
习题九	205
第十章 宏观经济政策的原理和运用	206
学习目标	206
第一节 财政政策	207
一、财政政策工具	207
二、自动稳定器	209
三、挤出效应	210
四、财政政策的限制	214
第二节 货币政策	216
一、货币政策工具	216
二、货币政策的传导机制	219
三、货币政策效果	220
四、货币政策的限制	222
习题十	223
第十一章 经济周期波动	225
学习目标	225
第一节 经济周期概述	226
一、经济周期的定义和阶段	226
二、经济周期的类型	227
第二节 经济周期的基本理论	229
一、经济周期理论的分类	229
二、单一因素周期理论	231
三、实业周期理论	231
四、储蓄投资过程周期理论	232
五、新古典主义周期理论	235
第三节 卡尔多经济周期模型	236
一、投资函数和储蓄函数的扩展分析	236
二、投资和储蓄的多重均衡	239
三、经济周期模型	240

第四节 乘数—加速数相互作用模型	242
一、模型框架	242
二、国民收入的动态变化	243
习题十一	245
 第十二章 宏观经济的长期增长	246
学习目标	246
第一节 经济增长概述	247
一、经济增长和经济发展的含义	247
二、经济增长的主要因素	249
第二节 哈罗德—多马经济增长模型	251
一、模型框架	251
二、经济增长的动态路径	253
第三节 新古典增长模型	254
一、集约形态的总量生产函数	255
二、新古典增长模型的基本框架	256
三、储蓄率变动的影响	258
四、劳动力增长率变动的影响	259
五、资本的黄金律水平	260
六、技术进步对经济增长的影响	261
习题十二	262
 参考文献	264

第一章

导论

看似一群群人杂乱无章地散布各处,可从直升飞机上看却是一幅美妙的图画,每个人都成为这幅图画的构成部分。单个人微不足道的但又不可或缺,个体的独特与整体的和谐恰成对比。这就是宏观和微观之分野。

——题记

学习目标

通过本章的学习,你应当能够:

1. 理解宏观经济学的研究对象及其与微观经济学的区别和联系;
2. 了解宏观经济学的基本理论框架;
3. 熟悉国内生产总值、通货膨胀、通货紧缩、失业和失业率等基本宏观经济学概念;
4. 了解学习和研究宏观经济学对个人职业生涯与企业经营管理的意义。

正如题记中描述的那样,宏观经济学(Macroeconomics)侧重于从经济整体的角度出发分析经济变量的决定与变化的问题。本章主要阐述宏观经济学的基本研究对象、逻辑框架和主要宏观经济问题,在此基础上说明学习和研究宏观经济学的意义。

第一节 宏观经济学的涵义

一、宏观经济学的研究对象

从字面上来看,所谓宏观就是“大而观之”、“总体上考察”的意思。经济学涉

及在资源稀缺的情况下如何有效地配置资源,作出资源使用的最佳决策。从微观上考察时,我们可以把考察重点放在一个典型的消费者或生产者身上,假定其他人的行为是给定^①的,不考虑或较少考虑消费者或生产者作为总体的影响。概言之,微观经济学考察资源总量给定条件下,这些资源如何被分配用于各种不同用途,研究一个经济社会生产什么产品、每种产品生产多少,以及它们的相对价格如何决定,单个消费者依什么原则决定自己的收入用于不同产品的数量,单个生产者按什么原则决定生产什么产品,等等。而宏观经济学的视角从单个消费者、单个生产者和单个市场转移到整个国民经济活动,将经济社会视为一个整体进行分析。如果下一个一般性定义,那么宏观经济学就是以国民经济的总体活动作为考察对象,研究各种总体经济变量的决定、变动及其相互关系,分析和解决就业、失业、通货膨胀、经济周期、经济增长、政府收支、国际收支等整体经济问题的经济学分支体系。

著名经济学家德恩伯格(T.Dernburg)在其《宏观经济学》中指出:“宏观经济学研究诸如总产量、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什么。宏观经济学衡量整个经济活动;它分析宏观经济政策的决定;它预测未来的经济活动;并且力图提出旨在使预测与生产,就业与价格的目标值相一致的政策反应。”

由此可见,在某种程度上宏观经济学跳出了分析经济体系中单个细胞的“近视”框架,使经济学分析能够从全局上把握经济形势的发展变化,从而为政府采取相关的宏观经济政策提供了较为充分的理论基础。

二、宏观经济学的理论体系

不少学者认为宏观经济学体系庞杂,是由各类宏观经济模型堆积而成的模型集,缺乏一以贯之的理论逻辑。以新古典主义(理性预期学派,如卢卡斯、萨金特等人)为代表的许多学者致力于为宏观经济学提供理论基础,建立内在逻辑一致的经济体系。这也是当前宏观经济学研究的重点领域之一。不过,尽管对于当前主流宏观经济学的理论体系众说纷纭,还是可以概括出如下图 1.1 所示

^① “给定”一词应当从两个角度理解,其一是“不变”,即当一个经济主体作出相关决策时,其他行为主体不会作出因应对策。例如,当人们对苹果更加偏爱时,会增加对其的需求,这时并不考虑人们对苹果与其他水果间的相对偏好关系;其二是“行为方式确定”,即当一个经济主体的某种行为会引致其他行为主体确定的反应。微观经济学中古诺模型中的“产量假定”就是“行为方式确定”的例子。

的基本理论逻辑体系。

归纳而言,当前主流宏观经济学可以概括为五个大的方面,即国民经济核算、国民收入决定、国民收入变动、宏观经济问题和宏观经济政策。国民经济核算可以看作是宏观经济学的预备知识,主要是说明相关宏观经济总量,尤其是国内生产总值(Gross Domestic Product, GDP)是如何核算出来的,在宏观经济学研究中如何运用国民经济统计中获得的相关数据,本书第二章将详细介绍这方面的内容。

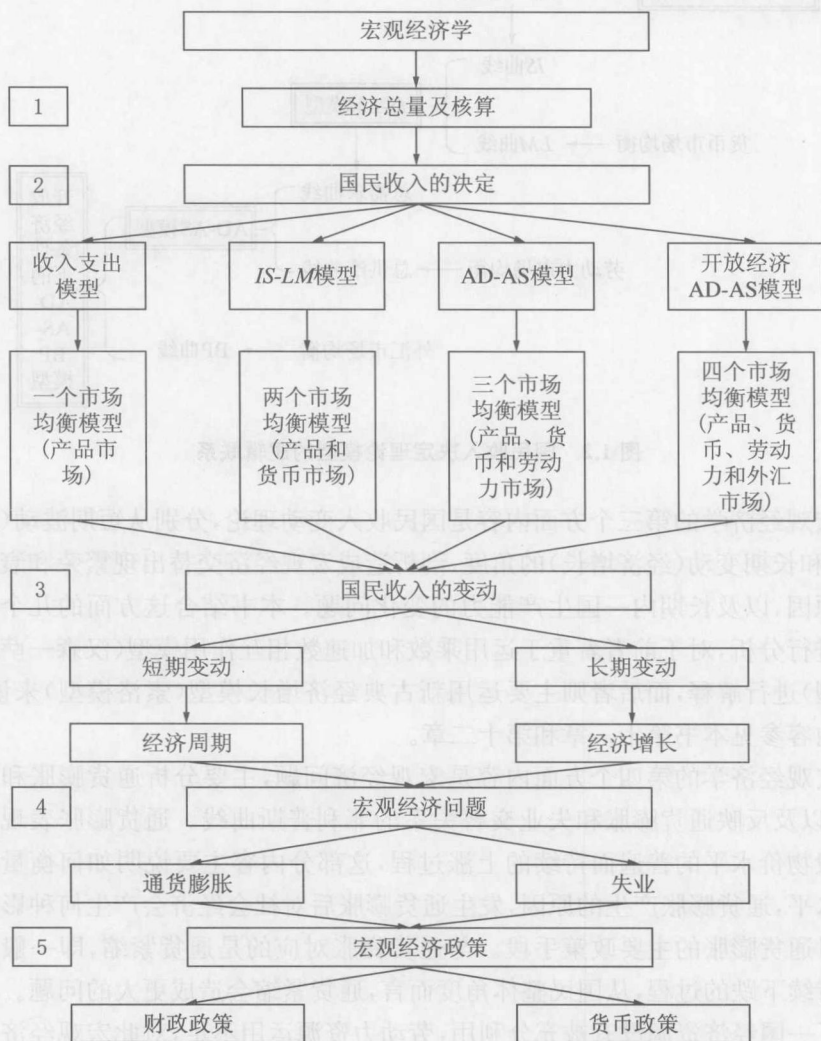


图 1.1 宏观经济学的理论体系

宏观经济学的第二个方面的主要内容涉及国民收入的决定理论,这是宏观经济学要解决的核心问题,是其他内容赖以成立的基础。这一部分主要由四个层次的理论模型构成,从简单到复杂大致可归纳为收入—支出模型、产品市场和货币市场同时均衡模型($IS-LM$ 模型)、总需求总供给模型($AD-AS$ 模型)以及开放经济条件下的总供求模型($AD-AS-BP$ 模型)。这四个层次模型的逻辑联系如图 1.2 所示。本书分别第三章至第八章和第十五章详细介绍这些宏观经济模型。

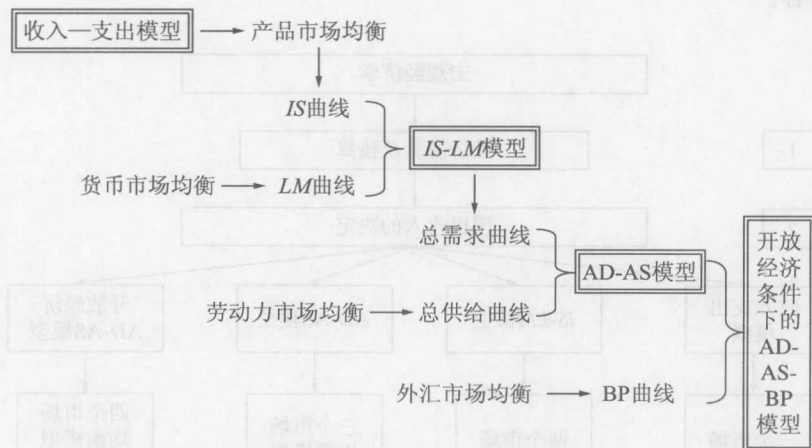


图 1.2 国民收入决定理论模型的逻辑联系

宏观经济学的第三个方面内容是国民收入变动理论,分别从短期波动(经济周期)和长期变动(经济增长)的角度,剖析造成宏观经济交替出现繁荣和衰退的主要原因,以及长期内一国生产能力的变化问题。本书结合这方面的几个重要模型进行分析,对于前者着重于运用乘数和加速数相互作用模型(汉森—萨缪尔森模型)进行解释,而后者则主要运用新古典经济增长模型(索洛模型)来说明。详细内容参见本书第十一章和第十二章。

宏观经济学的第四个方面内容是宏观经济问题,主要分析通货膨胀和失业问题,以及反映通货膨胀和失业交替关系的菲利普斯曲线。通货膨胀表现为一国一般物价水平的普遍而持续的上涨过程,这部分内容主要说明如何衡量一般物价水平,通货膨胀产生的原因,发生通货膨胀后对社会经济会产生何种影响以及应对通货膨胀的主要政策手段。与通货膨胀对应的是通货紧缩,即一般物价水平持续下跌的过程,从国民整体角度而言,通货紧缩会造成更大的问题。失业反映了一国经济资源没有被充分利用,劳动力资源运用不足,对此宏观经济学中主要分析造成失业的主要原因。早期菲利普斯曲线是政府解决失业和通货膨胀问题的一项重要政策指南,但在 20 世纪 70 年代以后菲利普斯曲线所反映的