

《中级宏观经济学》

主讲:何樟勇

浙江大学经济学院

2023年春



第一讲 简介

- **一、宏观经济学的分析方法**
- **二、本教学的定位与基本内容**

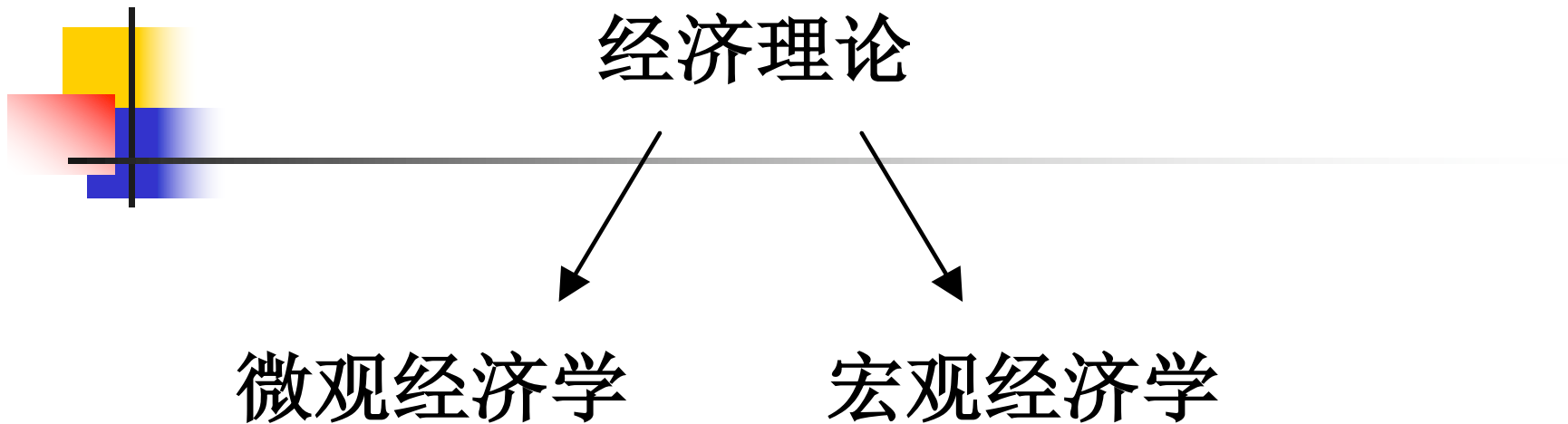


一、宏观经济学的方法



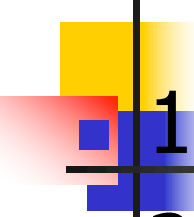
经济理论的划分

- 经济学研究被典型地分为微观和宏观两部分。
- 在**1980**年代以前，宏观经济学的研究方法明显地与微观经济学相区别。
- 这种区别现在已经消失了。在历史上被微观经济学运用的标准**经济理论**，现在已经被引入到宏观经济分析中来了。



现在我们已经不能用分析方法和技术来区分微观和宏观了。这两个学科的界限（非常广）必须通过他们研究的问题来划分。

宏观经济学的大问题

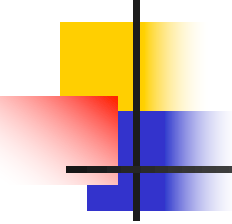
- 
- 1. 什么致使经济发生持续的增长？
 - 2. 政府是否能够做一些事情或者政府是否应该做一些事情来改变经济的增长？
 - 3. 商业周期形成的原因是什么？
 - 4. 政府是否应该设法抹平商业周期？
 - 5. 政府可以借助怎样的政策来抹平商业周期

宏观经济学家是怎样设法来回答这些问题的？

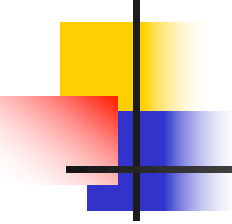


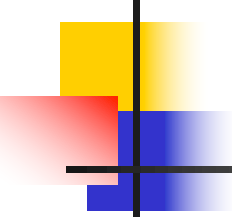
宏观经济学“实验”

- 当货币供应量突然增加了，这会对总产出、就业和价格水平产生怎样的影响？
- 具体一点，你可以想像有一架直升飞机向我们抛撒货币，从而使每个人手头的现金增加了**5000元**。

- 
- 用**实验**来回答这些问题。我们现在需要的是一个替代的世界——一个存在于想象中的，在所有方面都与我们自己相同的世界——在那里，有一个万能的神，他能做实验（为每个人增加**5000元**现金）并记录下他的观察，最后，他把他的观察汇报给我们。

显然是不可能的，也有点稀奇古怪。

- 
- **问题：**我们研究的对象非常特殊，因此，实验的方法在传统上是不能为宏观经济学家所用的。
 - 我们并不孤单。宇宙学家、地质学家以及气候学家也都面临着像我们一样的尴尬。

- 
- 例如，气候学家对如下问题的答案是非常感兴趣的：
-

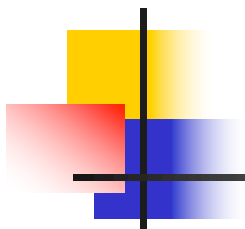
- 假设世界的CO₂释放率增加一倍，地球表面的平均气温将会发生怎样的变化？

- 因为不存在另一个“相同的地球”，实验是不可能进行的。



我们能做什么？

- 解决方案：构建一个“人工的世界”，在那里，我们可以操作实验。
- 这些人工的世界就叫**模型**。一个模型是一个正式清晰的**理论**（常用数学表达）。



- 我们现在借助“假想的经济”在虚拟中进行实验！这种实验可以为我们提供对诸如“假如.....会怎么样”这类问题的答案。

怎样我们才能知道一个模型确实给我们提供了一个好的，也即有用的答案？



至理名言：

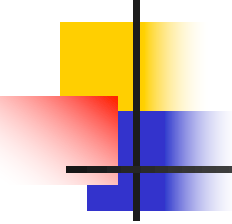
所有模型都是虚假的！

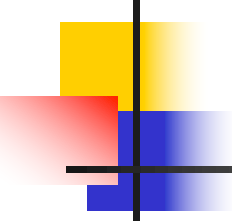
- 为什么？一个模型要有用，就必须简单。
- 例子。考虑一张地图，如果它完整地复制了现实，将一文不值。
- **道德：**从来不要攻击一个理论（或者模型）太简单，因为它从来不是为了完整地记录下你生活的世界。

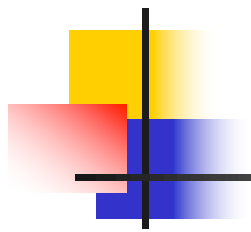


宏观经济模型的一般特征

- 一般来说，任何一个经济模型都含有不同类型的行为主体，这些行为主体在一定的预算条件下做自己的决策。因此，当我们在构建一个模型时，尽可能地描述清楚模型中行为主体所处的状态是非常关键的。这种状态包括行为人要做什么决策，他（她）们在做决策时会受到怎样的约束，当他（她）们在做决策时拥有怎样的信息等等。通常，一个模型会有如下三类决策主体

- 
- 第一，家庭（消费者）。对于家庭这个行为主体，我们必须描述清楚他（她）们的偏好以及他（她）们拥有的要素禀赋。家庭通常被假设在一定的约束下最大化他（她）们的偏好。他（她）们的最优决策解一般会依赖于他（她）们拥有的初始禀赋以及市场的价格。

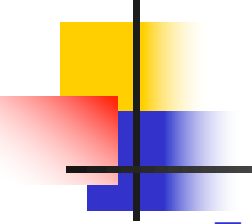
- 
- 第二，企业。对于企业，我们必须交代清楚企业可以获得的技术状况，也即描述清楚企业是如何把一些商品（投入）转换成另一些商品（产出）的。也就是说要描述清楚生产函数的性状。企业在模型中一般被假设为是在一个给定的技术水平下，通过选择合适的要素适用数量来最大化自己的利润。

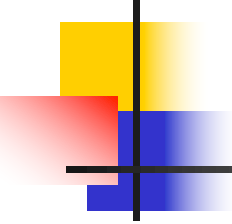
- 
- 第三，政府。对于政府，在模型中我们要交代清楚政府能采用的政策工具是什么（税收、货币供给等等）。通常，我们都把政府政策视为是外生给定的，然后看一看当这些外生给定的政策发生变化时，对家庭以及企业的最优化行为会有怎样的影响。



经济模型的基本层次

- 经济模型一般由三个层次组成：
- 第一个层次，经济学家把一些人们做决策前的经济环境用一些数学函数来描述，例如用效用函数描述人的嗜好和欲求，用生产函数描述生产条件，用预算约束描述制度环境，或用对策论中的游戏规则描述经济制度。

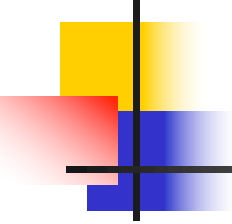
- 
- 第二个层次，经济学家用数学中的最优决策理论分析人的自利行为。这个层次的分析结果一般被称为决策的比较静态分析，即对当环境变化时，最优决策会如何作出反应的分析。
 - 第三个层次，经济学家用均衡概念分析不同人的自利行为交互作用产生的结局。 又可以分为局部均衡分析和一般均衡分析。

- 
- 这第二、三层次的分析中如果考虑时间因素，则分别会有动态决策和动态均衡分析。第一、二、三层次的分析都被称为实证分析。



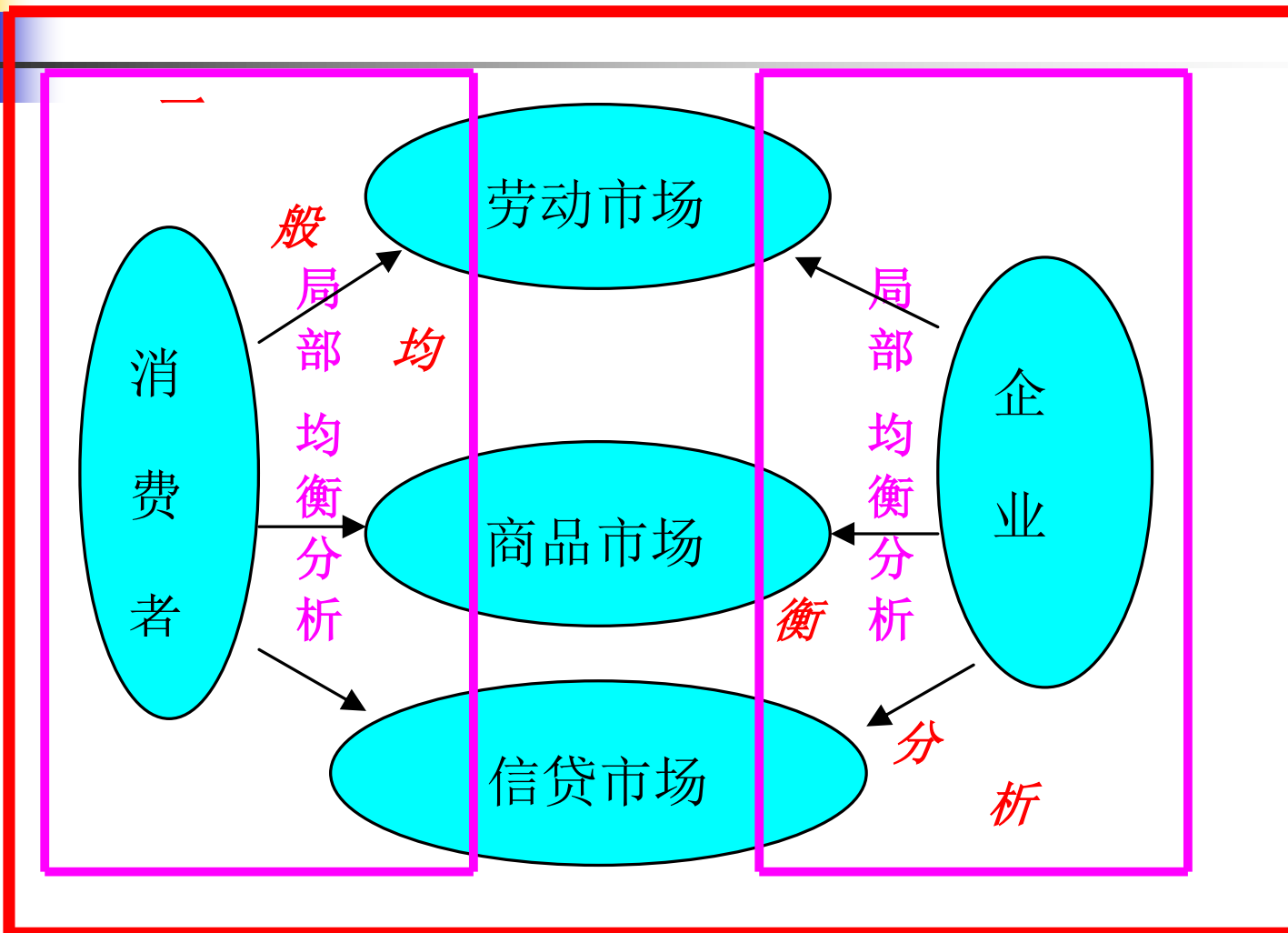
两个让模型得以运转的基本假定

- 1.消费者和企业都被假设追求**最大化**。
 - 在给定他们面临的约束后，他们一定尽自己所能让每件事做的最好。
 - 约束条件绝大部分是由可获得的技术和市场价格决定的。

- 
- 2.消费者和企业之间的结合是由竞争均衡来确保的。
 - 在一个竞争均衡中，单个消费者和企业的行为都不影响市场价格。
 - 也就是说，他们都是在“价格给定”的条件下追求最大化。
 - 在所有的市场，价格都能确保供给等于需求。

宏观经济分析的基本方法

——一般均衡分析





特别提醒：学习宏观经济学需要注意的两点。

- 第一，宏观经济学注重一般均衡分析
- 第二，在宏观经济学里，时间概念非常重要。



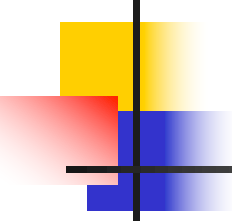
二、本教学的定位与基本内容



本教学的基本定位

- 1.偏重理论，从微观基础出发分析宏观经济问题，为进一步研习高级宏观经济学打基础、作铺垫！
- 2.梳理清楚宏观经济分析的基本思路与方法！
- 3.克服对数学的敬畏！

本教学的基本内容

- 
- 第一讲：简介
 - 第二讲：单期代表性行为人模型
 - 第三讲：两期动态模型
 - 第四讲：三期动态模型
 - 第五讲：无限期动态模型
 - 第六讲：索洛增长模型
 - 第七讲：新古典增长模型
 - 第八讲：代际交叠模型



教学内容的安排理由

- 宏观经济学家需要借助模型来思考问题
- 各宏观模型之间是有内在联系的
- “时间概念”是串联各模型的基本线索
 - 静态一般均衡
 - 动态一般均衡
 - 动态稳定一般均衡

课程教学模式：线上线下混合教学

考试成绩组成

- 平时成绩：40%；期末卷面成绩：60%
- 具体构成
 - 课程的最终评分由线上线下共同构成，线上占24%，线下占76%。其中，线上的24%由线上学习率、线上随堂测试和线上讨论互动三部分组成，每部分各占8%，共占24%。线下的76%由平时点名、课后作业以及期末闭卷考试成绩三部分构成，分别占8%、8%和60%，共占76%。



指定教材


- 何樟勇、宋铮编著《高级宏观经济学》，高等教育出版社**2010**年版。

高等学校西方经济学课程系列教材

高级宏观经济学

袁志刚 总主编

何樟勇 宋 铮 编著

 高等教育出版社
HIGHER EDUCATION PRESS

推荐参考书：

- 1、【英】布赖恩·斯诺登等著《现代宏观经济学指南》，商务印书馆1998年版。
- 2、【英】布赖恩·斯诺登等著《与经济学大师对话》，北京大学出版社2000年版。
- 3、【英】布赖恩·斯诺登等主编《宏观经济学发展的反思》，商务印书馆2000年版。
 - 这三本书是了解宏观经济学发展脉络的最佳选择。大师手笔，深入浅出，没有让许多人望而却步的数学公式。

- 4、【美】戴维·罗默著《高级宏观经济学》
(第五版)，上海财经大学出版社**2021**年版。
是学习高级宏观经济学最佳入门教材。原著已经出第五版了，在国内市场中英文版都有出售。
- 5、【美】布兰查德、费希尔著《宏观经济学》
(高级教材)，经济科学出版社1998年版。
 - 真正的高级宏观经济学，有点深奥。说是教材，好多章节实际是由论文组合而成，经常会碰到“经过一系列数学处理，就可以得到……”这种论文写作的笔调，要想真正得到教材所给出的东西，还需要你付很大的代价。这是该教材与罗默教材的区别之处，罗默教材都以具体例子来代替一般的结论，因而要简单一些，也更适合初次接触高宏的学习者。



推荐参考书：数学

- 1.[美]阿维纳什.K.迪克西特，译者：冯曲和吴桂英：《经济理论中的最优化方法》（第2版），上海人民出版社，2006年。
- 2.[美]蒋中一：《动态最优化基础》，商务印书馆，1999。



推荐方法论：

- 1.田国强：《现代经济学的基本分析框架与研究方法》，《经济研究》2005年第2期。
- 2.林毅夫：《论经济学方法》，北京大学出版社，2005年。



进一步阅读的文献

- Blanchard, O. 2000. “What do We Know about Macroeconomics that Fisher and Wicksell did not?”, NBER Working Paper 7550.
- Woodford M. 1999. “Revolution and Evolution in Twentieth-Century Macroeconomics”. Paper presented at the conference “*Frontiers of the Mind in the Twenty-First Century*”, Library of Congress, Washington, June 14-18.