



# 西方经济学

(宏观部分)

## 第十九章 经济增长和 经济周期理论

# 目 录

## 第一节

### 经济增长概述

- 长期增长趋势和波动;
- 经济增长和经济发展;
- 增长核算和因素分析

## 第二节

### 经济增长理论

- 新古典增长模型;
- 内生增长理论;
- 促进增长的政策

## 第三节

### 经济周期概述

- 经济周期的含义;
- 经济周期的特征

## 第四节

### 经济周期理论

- 对理论的简要回顾;
- 乘数-加速数模型;
- 实际经济周期理论



# 第一节 经济增长概述



## 一 长期增长趋势和波动



- **充分就业产量**或潜在产量是在经济中现有资源被充分利用时所能生产的产量。
- 随着时间的推移，资源的可得性增加，使经济体能生产出更多的商品和劳务。
- 实际产量不总是处于其趋势水平，更经常地，产量围绕其趋势水平波动。
- **经济波动**是无规律的，衰退并不是有规律地间隔发生，持续时间和程度也是不同的。



# 第一节 经济增长概述



## 二 经济增长与经济发展

- **经济增长**通常被定义为产量的增加；**经济发展**反映总体发展水平的综合性概念。

$$g_z = \frac{Z(t+1) - Z(t)}{Z(t)} \quad g_y = \frac{y_t - y_{t-1}}{y_{t-1}}$$

- 经济增长是一个“量”的概念，而经济发展概念宽泛，是一个“质”的概念。  
    常规增长率      总产量增长率
- 经济增长是手段，经济发展是目的；经济增长是经济发展基础，经济发展是经济增长结果。



# 第一节 经济增长概述

## 二 经济增长与经济发展

- 有缺陷的GDP可以粗略地度量一国生活水平，是现成指标但不是完美指标；衡量了人们过上一种有意义生活的投入能力，增长率微小差别会导致相对生活水准的显著差异。
- 经济增长涉及的基本问题：第一，为什么一些国家如此富裕而另一些国家那么贫穷？第二，什么是影响经济增长的因素？第三，怎样理解一些国家和地区的增长奇迹？



# 第一节 经济增长概述

## 三 增长核算和因素分析



- 与增长相关的基本来源是对一国积累要素能力以及投资于知识能力产生影响的变量。

社会能力

$$Y_t = f(K_t, R_t, N_t, A_t, S_t)$$

- 非经济因素尤其是制度因素是经济增长中应考虑的，一个社会只有在具备了经济增长所要求基本制度条件，有了一套能促进经济增长的制度之后，直接因素才能良好地发挥作用。



# 第一节 经济增长概述

## 三 增长核算和因素分析



- 生产函数给出了投入与产出之间的数量关系。
- 经济增长源泉可以被归结为生产要素(劳动

量 劳动份额 的增长和技术进步 资本份额

$$Y = A F(N, K)$$

$$\frac{\Delta Y}{Y} = \alpha \frac{\Delta N}{N} + \beta \frac{\Delta K}{K} + \frac{\Delta A}{A}$$

$$\frac{\Delta A}{A} = \frac{\Delta Y}{Y} - \alpha \frac{\Delta N}{N} - \beta \frac{\Delta K}{K}$$

索洛余量



# 第一节 经济增长概述

## 三 增长核算和因素分析

- 美国经济学家丹尼森把经济增长因素分为两大类：生产要素投入量和生产要素生产率。
- 要素生产率是产量与投入量之比，主要取决于资源配置状况、规模经济和知识进展。
- 知识进展是发达资本主义国家最重要的增长因素，包括技术知识、管理知识进步等。
- 管理和组织知识的进步更可能降低生产成本，这比改善产品物理特性的影响更大。







## 第二节 经济增长理论

### 一 新古典增长模型



- 新古典增长模型是由美国经济学家索洛和澳大利亚经济学家斯旺于1956年提出的。
- 其核心是关于总量生产函数性质的三个假设：规模收益不变性、生产要素的边际收益递减和生产要素之间的可替代性。

$$\dot{k} = s f(k) - (n + \delta) k$$

人均资本变化

人均储蓄

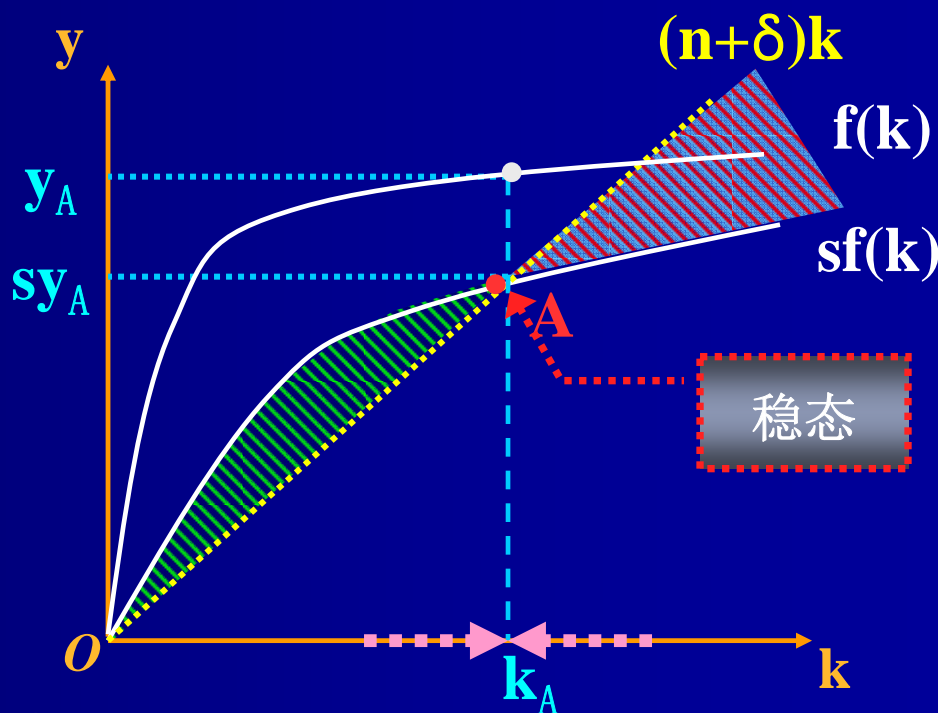
资本广化



## 第二节 经济增长理论

### 一 新古典增长模型

- **稳态**意味着包括资本存量和产出在内的有关内生变量将不会随时间的推移而变化的状态。
- 当经济偏离稳定状态时，无论人均资本过多还是过少，都存在着某种力量使其恢复到稳态，模型所确定的状况是稳定的。

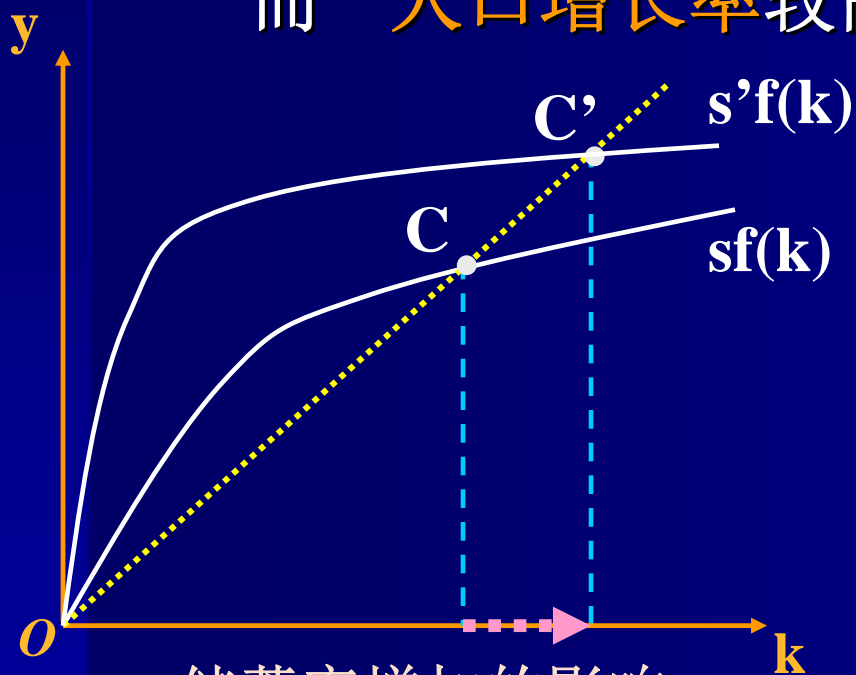


## 第二节 经济增长理论

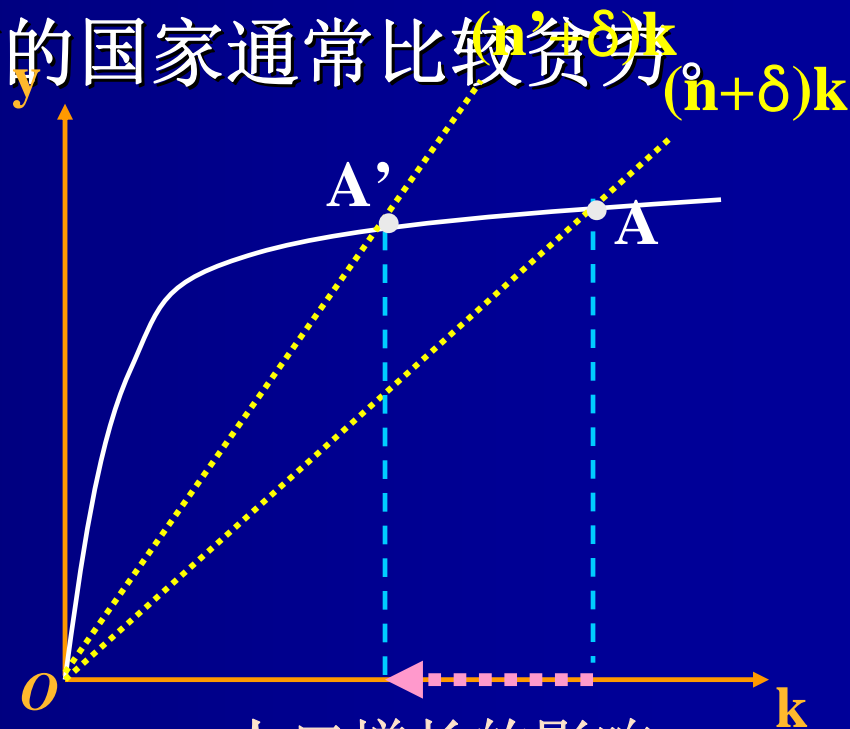
### 一 新古典增长模型



- 储蓄率或投资率较高的国家通常比较富裕，而人口增长率较高的国家通常比较贫穷。



储蓄率增加的影响



人口增长的影响







## 第二节 经济增长理论

### 二 内生增长理论



- 内生增长理论产生于20世纪80年代中期，核心思想认为经济能够不依赖外力推动实现持续增长，内生的技术进步持续增长的决定因素。
- 增长模型包含两条研究思路：第一条是罗默、卢卡斯等人用全经济范围的收益递增、技术外部性解释经济增长的思路；第二条是用资本持续积累解释经济内生增长思路，代表性模型是琼斯 - 真野模型、雷贝洛模型等。



## 第二节 经济增长理论

### 二 内生增长理论



- 经济增长的原因有：第一，获取新“知识”(革新、技术进步、人力资本积累等)；第二，刺激新知识运用于生产(市场条件、**产权**、政治稳定以及宏观经济稳定)；第三，提供运用新知识的资源(人力、资本、

$$\begin{aligned}
 Y &= A K \\
 \Delta K &= sY - \delta K \\
 \frac{\Delta Y}{Y} &= \frac{\Delta K}{K} = sA - \delta
 \end{aligned}$$

$$\begin{aligned}
 Y &= F [ K, (1-u)EN ] \\
 \Delta E &= g(u) E \\
 \Delta K &= sY - \delta K
 \end{aligned}$$



## 第二节 经济增长理论

### 三 促进增长的政策



- 许多公共政策在于鼓励技术进步，政府在改善技术增长方面的一个重要领域是教育。
- 一个社会可以改变所拥有的资本量，鼓励资本形成主要归结为鼓励储蓄和投资。
- **人力资本**是指劳动者通过教育和培训所获得的知识和技能，在许多方面与物质资本类似。
- 在各国生活水平差别中，人力资本与物质资本同样重要，政府提供良好的教育、培训体系。





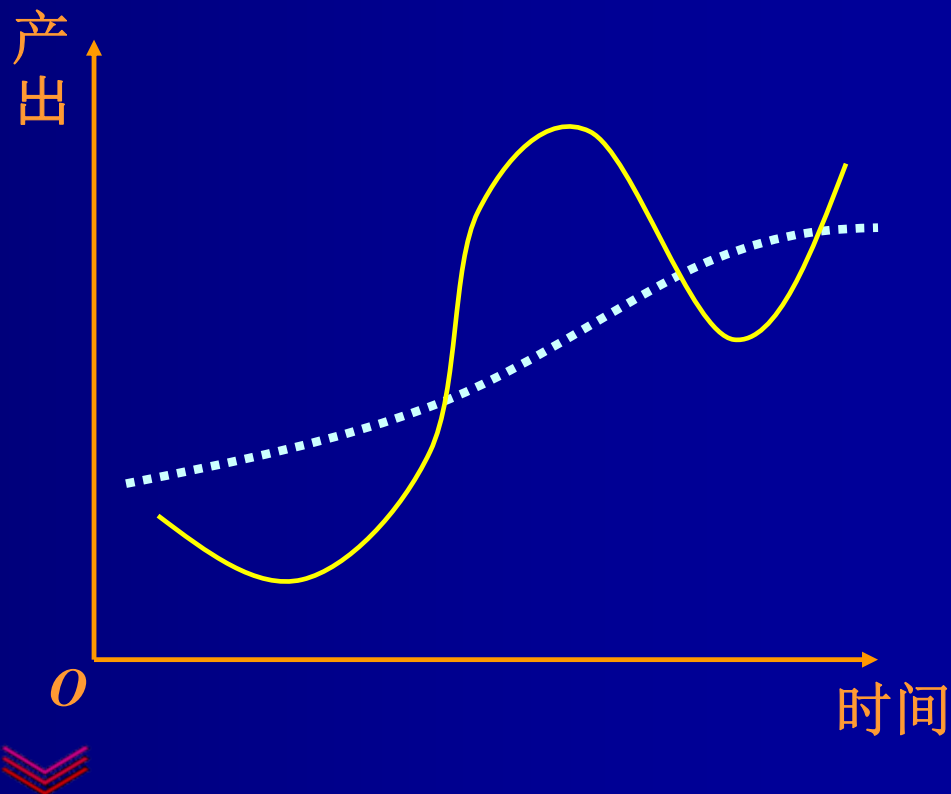


## 第三节 经济周期概述



### 一 经济周期的含义

- **经济周期**是指国民总产出、总收入和总就业的波动，以经济中的许多成分普遍而同期地扩张或收缩为特征的，发生在实际GDP相对于潜在GDP上升(扩张)或下降(收缩)的时候，经济周期的形式是不规则的。





## 第三节 经济周期概述

### 一 经济周期的含义

- 国民总产出、总收入和总就业的波动是总体经济活动扩张与紧缩的交替或周期性波动变化，分为繁荣、衰退、萧条和复苏四个阶段。
- 厂商对于经济周期的波动必须了解、把握，并能制订相应的对策来适应周期的波动。
- 一个企业无力决定它的外部环境，但可以通过内部条件的改善来积极适应外部环境的变化，充分利用外部环境，以增强自身活力。





## 第三节 经济周期概述

### 二 经济周期的特征



- 经济周期的**扩张阶段**：是宏观经济环境和市场环境日益活跃的时期，市场需求旺盛、订货饱满、商品畅销、生产趋升，厂商的供、产、销较好安排，处于较宽松有利的外部环境中。
- 经济周期的**收缩阶段**：是宏观经济环境和市场环境日趋紧缩的时期，消费者购买急剧下降、对劳动的需求下降、产出下降、厂商利润严重下滑，处于比较甚至极为恶劣的外部环境中。



## 第四节 经济周期理论

### 一 对理论的简要回顾



- 1825年，英国爆发了资本主义历史上的第一次生产过剩性经济危机，以后又经常出现。
- 法国学者朱格拉指出，危机不是一种独立的现象，而是周期性波动中的一个阶段。
- 二战以前的经济周期研究集中在两个问题上：其一，整理有关经济周期的历史资料，对经济周期进行分类；其二，研究经济周期的原因，一些学者提出了经济周期的理论。



## 第四节 经济周期理论

### 一 对理论的简要回顾



- 1860年, C.朱格拉, 《论法国、英国和美国的商业危机及其发生周期》, 9~10年中周期。
- 1923年, J.基钦, 其著作《经济因素中的周期与趋势》, 3~4年, 短周期。
- 1925年, N.康德拉季耶夫, 其著作《经济生活中的长期波动》, 50~60年, 长周期。
- 1930年, S.库兹涅茨, 其著作《生产和价格的长期运动》, 15~25年, 长周期。



## 第四节 经济周期理论

### 一 对理论的简要回顾



- 纯货币危机理论：英国人R.G.霍特里坚持认为经济周期和危机是纯粹的货币现象。
- 投资过度理论：主要倡导者是奥地利学派人士L.C.罗宾斯、F.von.哈耶克 和 L.von.米塞斯，货币引起生产领域两部门的组合比例失调。
- 创新周期理论：约瑟夫.A.熊彼特 认为企业家率先进行的创新活动，每一次创新造成的经济高涨必然继之以危机和萧条。



## 第四节 经济周期理论

### 一 对理论的简要回顾



- 消费不足理论：根源在于收入分配不平等，代表人物有马尔萨斯、西斯蒙第、霍布森等。
- 心理周期理论：预期对人们的经济行为有决定影响，乐观与悲观预期交替引起周期交替。
- 太阳黑子理论：农业生产状况会影响工业及整个经济，是典型的外生经济周期理论。
- **政治周期理论**：政治家为重新当选而对财政和货币政策进行操纵，代表人物是诺德豪斯。







## 第四节 经济周期理论

### 二 乘数-加速数模型

- **乘数 - 加速数理论**是把投资水平和国民收入变化率联系起来解释国民收入周期波动的一种理论，是最具影响的内生经济周期理论。
- 产量水平变动和投资支出数量之间的关系被称为加速原理，特别 **加速数** 投资变动的因素。

净投资

$$K = v Y \quad ; \quad K_{t-1} = v Y_{t-1} \quad ; \quad K_t = v Y_t$$

$$I_t = K_t - K_{t-1} \quad ; \quad I_t = v Y_t - v Y_{t-1} = v (Y_t - Y_{t-1})$$





## 第四节 经济周期理论

### 二 乘数-加速数模型



- 投资、收入和消费相互影响、相互调节，通过**乘数**和**加速数**，会自发地形成经济周期。

$$Y_t = \beta Y_{t-1} + v (C_t - C_{t-1}) + G_t$$

- 投资会影响收入和消费，收入和消费又影响投资，形成累积性的经济扩张或收缩局面。
- 因此，政府对经济实施干预政策，就可以改变或缓和经济波动，克服或缓和经济萧条。





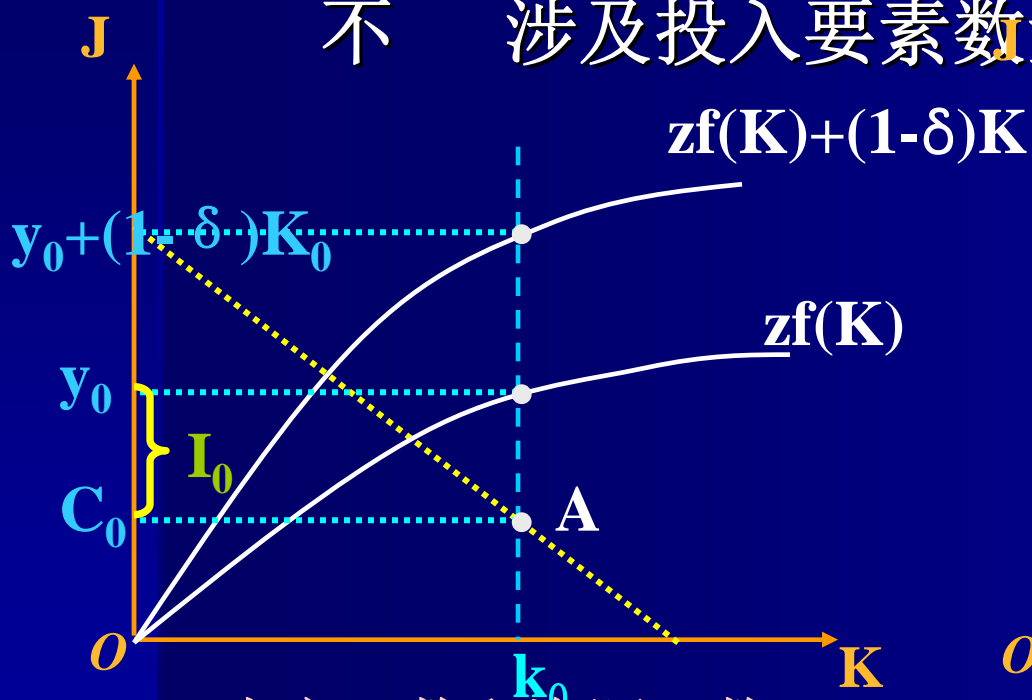
# 第四节 经济周期理论

## 三

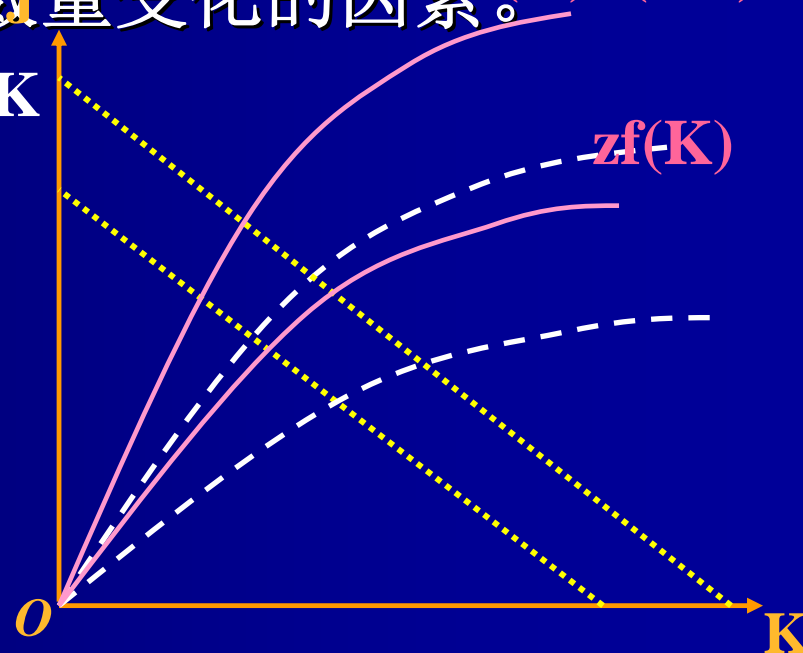
## 实际经济周期理论



- **技术变化**包括任何使生产函数发生移动，而不涉及投入要素数量变化的因素。



生产函数和资源函数



对经济波动的解释

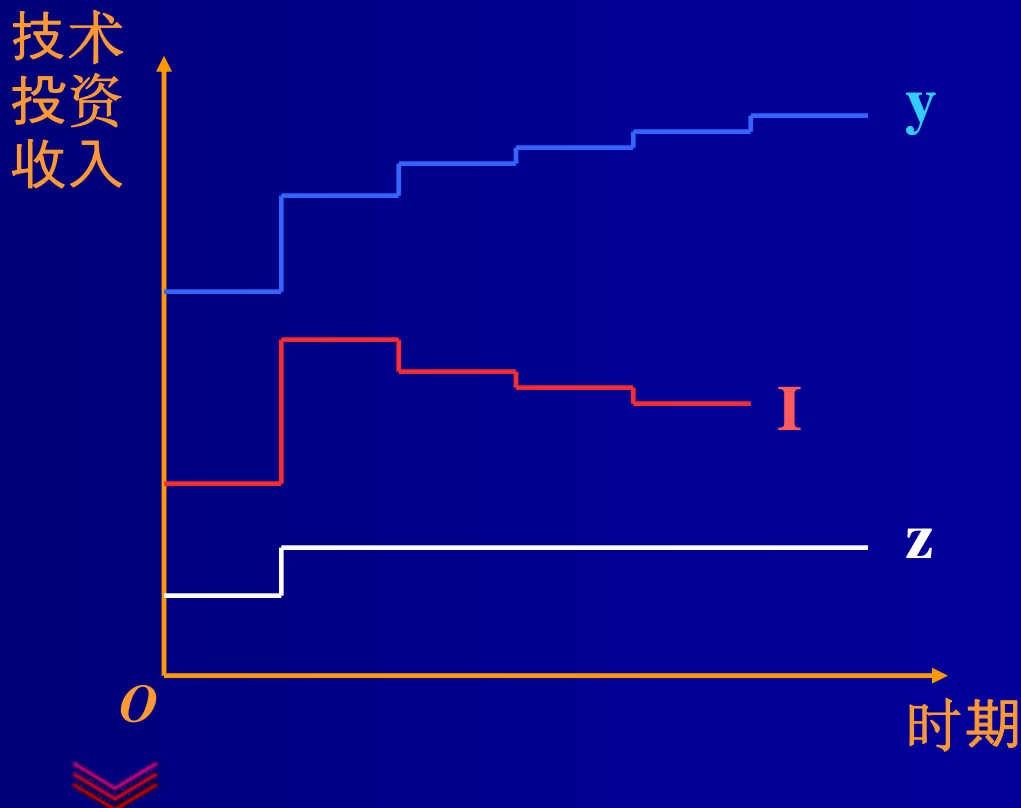


## 第四节 经济周期理论

### 三 实际经济周期理论



- 资源约束线的向外移动会在接下来的时期相继发生，但移动的幅度会越来越小，经济会向新的稳定状态收敛。
- 资本存量、收入、消费和投资都到新的稳态水平上，技术变化是收入和投资变动根源。





## [习题] 经济增长和经济周期理论

- 20 世纪 70 年代中期到 90 年代中期，美国经济增长放慢的主要原因是( )。
  - A 劳动力增长速度下降
  - ✓ B 技术进步的速度下降
  - C 资本存量增长率上升
  - D 经济全球化程度加深
- 当实际 GDP 高于潜在 GDP 时， 实际失业率将高于自然失业率。(✗)
- 宏观经济政策规则倾向于使经济在衰退时出现预算赤字，在扩张时出现预算盈余。(✓)

