



西方经济学

(宏观部分)

第二十一章 宏观经济学 争论和共识

目 录

第一节 理性预期

- 预期理论的演进；
- 预期定义和三大假说；
- 卢卡斯曲线； 政策主张

第二节 名义黏性

- 名义工资黏性；
- 名义价格黏性

第三节 基本共识

- 居民生活水平决定；
- 物品和劳务的生产；
- 预期的决定； 总产出的回复

第四节 科学主义

- 可验证性与分析方法；
- 假设条件与理论价值；
- 经济数据与事例研究



第一节 理性预期



一 预期理论的演进



- 早期经济学家看到了对未来判断的重要性以及预期对现实经济运行的影响，其中**瑞典学派**的事前与事后分析对预期理论做出了贡献。
- **凯恩斯**认为预期是一种难以把握的心理现象，这种心理活动与经济变量之间的关系是不明确的，长期预期常处于无理性的波动中。
- **理性预期学派**被认为是新古典经济学第二代，从货币主义学派中分化出来的。





第一节 理性预期



一 预期理论的演进

- “在一个不确定的世界和历史的时间中，决策是事先做出的，结果是事后得到的。”
- 静态预期：在蛛网理论基础上发展而来，是一种关于动态均衡分析方法的微观经济理论。
- 外推型预期：1941年，梅茨勒认为要以经济变量的过去水平和变化趋势为分析的基础。
- 适应性预期：1956年，卡甘认为经济主体会根据过去的预期的错误来修正以后的决策。





第一节 理性预期

二 预期定义和三大假说



- 1961年，约翰·穆斯撰写《理性预期与价格变动》一文，在借鉴以往预期模型的基础上，提出了理性预期(Rational Expectation)假说。
- 理性预期是指经济当事人为了避免损失和谋取最大利益而运用利用一切可以取得的信息，对所关心的经济变量做出尽可能准确的估计。
- **理性心理预期**方法反映在三个基本的“假说”：自然率假说、理性预期假说和货币中性假说。





第一节 理性预期



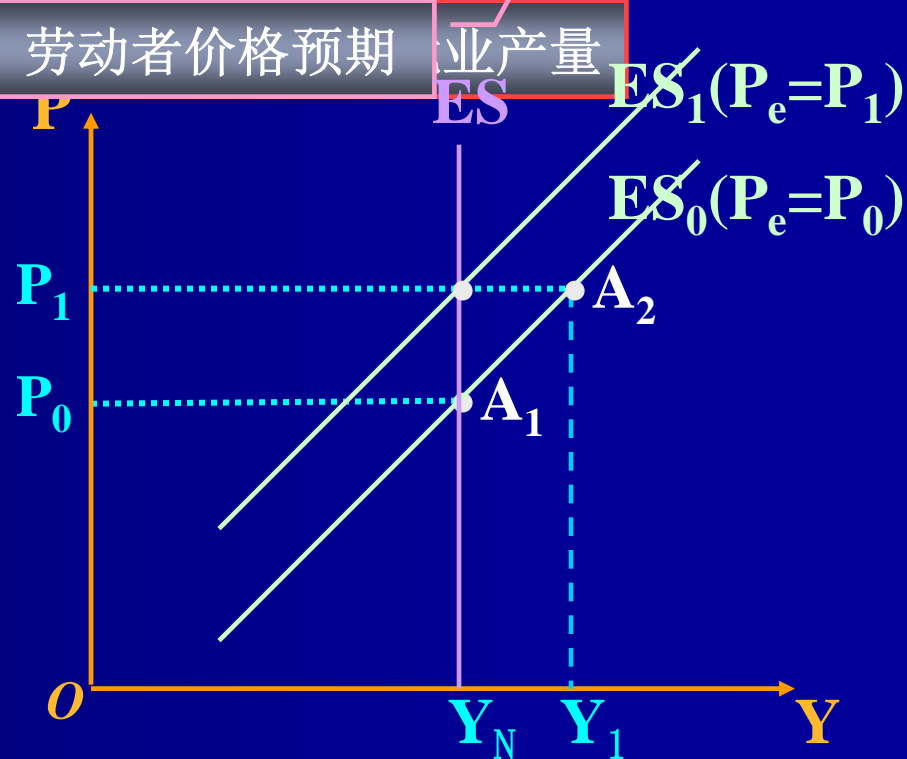
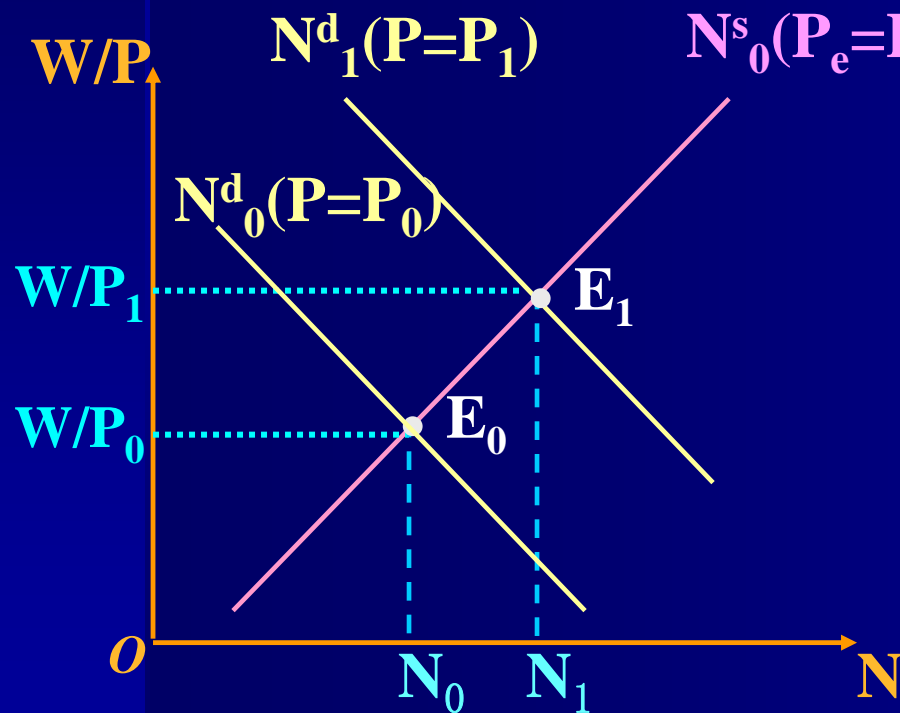
三 卢卡斯曲线

■ 卢卡斯曲线方程为

实际价格水平 产量

$$Y_t^s = Y_N + \beta (P_t - P_t^e)$$

劳动者价格预期 产量





第一节 理性预期

四 政策主张

- 理性预期学派主要侧重于对传统理论和政策的批判与否定，并没有提出系统的政策主张。
- 以追求经济发展的自然水平政策目标，反对人为地刺激产量和就业水平的增加。
- 崇尚自由经营，建立自然秩序，反对政府过多干预经济，包含了“**无为而治**”的思想。
- 宏观经济政策无效论，经济当事人能够迅速认识政策制定者意图，并事先采取预防措施。





第二节 名义黏性

一 名义工资黏性



- 20世纪70至80年代，早期的新凯恩斯主义者以长期劳动合同的形式引入了名义工资黏性。
- 工资不是在即时交易中决定的，而是由劳资双方以明确(或隐含)的合同确定的。
- 工会都签订了正规的劳动合同，非工会企业愿意支付也工会力量强大的企业相当的工资率。
- 合同影响经济的关键在于对工资变化的规定与对合同期限的规定，名义工资变动滞后。

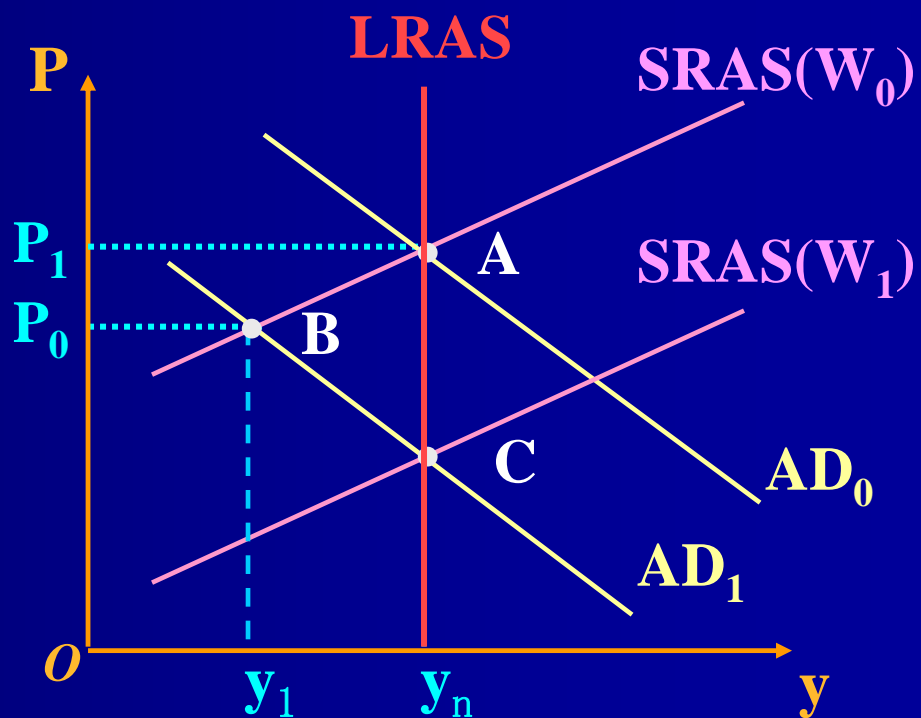




第二节 名义黏性

一 名义工资黏性

- **长期劳动合同**是实际收入和失业表现为周期性变化的原因之一，因为这在一定程度上限制了工资和价格的灵活性。
- 不变的名义工资使得货币当局能够影响实际工资率，从而影响就业和产量，相机干预有存在的理由。





第二节 名义黏性

二 名义价格黏性

- **菜单成本理论**认为价格黏性的原因是，经济中的垄断厂商是价格的决定者能够选择价格，而菜单成本的存在阻滞了厂商调整产品价格。

$$\pi(P^*) - \pi(P) = \pi'(P^*)(P^* - P) - \frac{1}{2} \pi''(P^*)(P^* - P)^2$$

- 在价格有黏性的情况下，只要有些调整没有发生，交易就有可能在非均衡价格下进行，这又可能导致过度供给和失业的波动。





第三节 基本共识



一 居民生活水平决定



- **GDP** 是衡量经济福利的重要指标，实际 **GDP** 衡量了该国满足居民需要和愿望的能力。
- 在长期中，**GDP** 依赖于包括劳动、资本和技术在内的生产要素，经济供给物品与劳务的能力是 **GDP** 惟一的决定因素。
- 在短期内，**GDP** 取决于物品与劳务的总需求数量，这强调总需求的重要性，总需求的变动对产出和就业的周期变动起主导作用。





第三节 基本共识

二 物品和劳务的生产

- 在短期内，GDP 依赖于经济的总需求，所有影响总需求的变量变化都能引起经济波动。
- 更高的消费者信心、较大的预算赤字和较快的货币增长都可能增加产量和就业。
- 财政政策不是短期内影响总需求的有效工具，但在长期中对各方面资源配置有重要作用。
- 治理通货膨胀往往会导致更严重的衰退，这种巨大的成本使得反通货膨胀得不偿失。





第三节 基本共识

三

预期的决定



- 经济人的预期对实际经济进程产生重要影响，宏观变化必须以微观原理为基础，忽视微观主体市场行为是凯恩斯经济学的一个缺陷。
- 经济政策实质是政府与公众间的互动和博弈，保持政策的连续和信誉是政府能否稳定经济的前提，这需要依靠有效的制度来保证。
- 公众从利益最大化的理性原则出发，对政策实施的可能进行预测并做出相应的趋避。





第三节 基本共识

四 总产出的回复



- 在长期中，总产出最终会回复到自然水平上，取决于自然失业率、资本存量和技术的状态。
- 长期总供给曲线是一条位于潜在产量水平上的垂直线，供给是**决定产出和就业**的主要力量。
- 与防止短期波动相比，促进长期增长对经济活动显得更为重要，要摆脱贫穷落后必须开放。
- 共识意味着宏观经济学逐渐走向成熟，分歧和争论则代表它的生机与活力。





【习题】宏观经济学争论和共识

- 根据卢卡斯的理性预期供给函数，一次预期的货币供给减少将导致()。
 - A 会降低价格水平而不会减少GDP
 - B 会减少GDP而不会降低价格水平
 - C 可能降低价格水平和产量
 - ☒ D 不会降低价格水平和产量
- 菜单成本理论解释了()。
 - A 名义工资黏性
 - B 实际工资刚性
 - ☒ C 名义价格黏性
 - D 实际价格刚性





第四节 科学主义



一 可验证性与分析方法



- 19世纪70年代，**科学主义**(Scientism)已出现，主张以自然科学技术为整个哲学的基础，认为科学方法能够应用于所有研究领域的原则。
- **分析方法**对于现代科学至关重要，表现在：为验证理论提供了可能性，提供了统一的研究范式，促进了学科分类的形成。
- 理论可验证性至关重要，这样的理论才能增加人类知识，分析方法是可验证的前提之一。





第四节 科学主义

二 假设条件与理论价值

- 早期经济学的发展带有明显的思辨风格，随着现代科学迅猛发展，经济学者开始自觉地运用分析方法，渗透到经济学研究的各个领域。
- 经济学的基本定理往往有很多**假设条件**，设置条件目的主要是为了排除其他因素的影响而单独考察某一因素的变化对目标变量的影响。
- 一个经济学说的理论价值以及其正确与否也不应当根据其假设条件的现实性来判断。





第四节 科学主义

二 假设条件与理论价值



- 经济学的学科体系与形式更接近于现代自然科学，与其他社会科学相比较，经济学所使用的分析方法具备量化的形式和被验证的可能。
- 自然科学的成就来源于分析方法的运用，这其中**实验科学**起到了至关重要的作用。
- 在经济领域，经济学家只是被动的观察者，作为分析科学的经济学必须要有计量工具来分离不同因素的影响并验证其理论。





第四节 科学主义

三

经济数据与事例研究



- **事例研究**不仅仅可对经济理论的验证，同时也是对经济现象的解释；给定了一个经济理论，还必须去寻找找到恰当的事例来验证它。
- 经济学是和历史学是相近的学问，经济学的论证不能说是科学的论证，而更接近艺术表现。
- 经济学的产生源于对现实世界的关注，经济学也要回归现实。**思想改变世界**，经济学以思想取胜，经济学家应以创造思想为满足。

