



# 宏观经济学与 微观经济学

## 经济学一分为二的原因所在

G. 克里斯·罗德里格

物理学家研究世界，一方面要研究行星、恒星、星系和万有引力等宏观世界；另一方面，他们也要研究原子以及构成原子的粒子等微观世界。

同样，经济学家也是从两方面来研究经济现象。一方面是宏观，即宏观经济学，分析的是整体经济的运行方式，比如就业、国内总产值和通胀等新闻和政府政策关注的问题。另一方面是微观，即微观经济学，分析的是单个商品和服务市场中供需间的相互关系。

在宏观经济学中，研究的主题往往是一个国家，即研究各个市场如何相互发生作用，形成经济学家称之为“综合变量”的宏观经济现象。而在微观经济学中，分析的对象则是单个的市场，比如汽车或者石油行业价格的上涨是否由供需变化所带动。在宏观经济学中，主要分析对象则是政府，比如研究政府在促进经济总体增长或者抑制通胀方面所发挥的作用。由于国内市场可以通过贸易、投资和资本流动与国外市场发生关联，因此宏观经济学往往扩大至整个国际层面。不过，微观经济学也可能涉及国际层面。单个的市场通常并不仅仅局限于单个的国家，比如，全球石油市场就是一个明显的例证。

经济学对宏观经济学和微观经济学进行了明确的划分，从“经济学原理”中的入门课程到研究生课程均是如此。经济学家通常将自己视为微观经济学家或者宏观经济学家。美国经济学会最近推出了几本新的学术期刊，一本叫作《微观经济学》杂志，另外一本相应地叫作《宏观经济学》杂志。

### 为何要如此划分？

在此之前，情况并非如此。事实上，从18世纪末到20世纪30年代的“大萧条”时期，经济学就没有宏观和微观之分，它研究的是人类社会如何组织商品和服务的生产、分配和消费状况。早期的经济学家，如经济学之父、苏格兰著名哲学家亚当·斯密等的研究成果，促成了经济学的形成。不过，早在亚当·斯

密的《国富论》于1776年问世前，其他学者就已开始对经济现象进行研究。亚当·斯密“看不见的手”理论是社会科学最具吸引力的理论之一，该理论指导那些寻求自身福利最大化的个人同时为整个社会提供总体最佳的效益。在工业革命开始时，亚当·斯密和其他早期的经济思想家，如戴维·休姆等共同创建了经济学。

从亚当·斯密的《国富论》问世到“大萧条”期间，经济理论迅猛发展，不过彼时经济学尚未划分为微观经济学和宏观经济学。经济学家们认为，市场要么处于平衡状态——在此情况下，物价将自动进行调节，从而保持市场供需间的平衡；要么暂时性受到冲击，如金融危机或者饥荒，但市场也将快速恢复平衡状态。换句话说，经济学家认为，对单个市场的研究将足以解释我们现在称之为综合变量，如失业和产值的运行状况。

在“大萧条”期间出现的全球经济活动长期严重崩溃局面，彻底改变了上述理论格局。并非经济学家当时未能意识到综合变量可能出现不稳定状况。事实上，他们对经济周期开展了研究。所谓经济周期，是指经常受严重变化或者经济危机的影响，各个经济体定期从产值和就业不断增加的状况，转向增长萎缩或者不断走低而失业率不断上涨的局面。同时，经济学家也研究了货币及其在经济中的作用。不过，当时的经济学并未对“大萧条”作出解释。这是因为，在传统的市场总体处于平衡理论模式下开展研究的经济学家无法对20世纪30年代出现的极度“市场失灵”现象作出合理的解释。

如果说亚当·斯密是经济学之父，那么约翰·梅纳德·凯恩斯就是宏观经济学的奠基人。尽管现代宏观经济学的部分理论来自于19世纪末和20世纪初的部分学者，如欧文·费雪和克努特·维克塞尔的作品，但宏观经济学真正作为一门完全独立的学科，还是起源于凯恩斯于1936年出版的名著《就业、利息和货币通论》，其主要关注的问题是综合变量的不稳定性。早期的经济学

主要侧重于研究单个市场的均衡性，而凯恩斯则同时对三个相互关联的市场，即商品市场、劳动力市场和金融市场的均衡性问题开展研究。同时，他还引入了“不均衡经济学”的理论，明确研究偏离总体均衡的经济状况。他的研究方法被其他著名的经济学家所采纳，并迅速发展成为当今的宏观经济学理论。

## 共存与互补

微观经济学是基于消费者或企业（经济学家将其称为“代理人”）的模型进行研究，这些消费者或企业作出购买、销售或生产何种产品的决定，其假定条件是这些决定将导致出现完美的市场出清（即供给量与需求量相等）和其他理想状况。而宏观经济学则是通过对古典传统状况下预期结果的背离状况进行研究。

如今，这两个领域彼此共存，互为补充。

微观经济学侧重于研究单个的消费者和企业行为，又分为消费者需求理论、生产理论（也称之为企业理论），以及其他相关的主题，如市场竞争性质、经济福利、不完全信息对经济成果的影响，以及最为抽象的、同时研究很多市场的总体均衡理论。从本质上讲，很多经济分析都是微观经济分析。微观经济学主要关注的问题是最低工资、税收、价格补贴或者垄断等因素对单个市场的影响，很多概念在现实生活中可以得到发现。微观经济学又分为贸易、工业组织和市场结构、劳动力经济学、公共财政和福利经济学。微观经济学分析可以为制定企业决策或者制定公共政策等不同活动提供真知灼见。

相比而言，宏观经济学更为深奥难懂。宏观经济学描述的是那些庞大到难以理解的不同综合变量之间的相互关系，这些综合变量包括国民收入、储蓄以及总体物价水平等。宏观经济学通常又分为对国家长期经济增长的研究、对短期经济均衡偏离状况的分析，以及对如何制定稳定国民经济发展的政策（即最大限度减小经济增长和物价的波动）研究。这些政策包括政府采取的支出和税收措施，以及中央银行采取的货币政策措施。

## 缩小微观和宏观经济学之间的鸿沟

与物理学家一样，经济学家也需要建立组织和简化某个领域知识的理论，并制定增加新知识的概念框架。一门学科的建立，总是以非正式洞见的积累为基础，尤其是对不同变量之间有规律关系的观察结果，这种相互关系非常稳定，可纳入“规律”的范畴。而理论则是通过实验和正式的逻辑推理——称之为“模型”（见《金融与发展》2011年6月号“什么是经济模型？”），记录下这些不变关系而得出的。

自“凯恩斯革命”以来，经济学基本分为两大理论体系，一种理论体系用来解释微观层面，另一种则用来解释宏观层面（micro 和 macro 在希腊语中分别是“小”和“大”的意思）。但在过去的25年左右，按照物理学的新研究方法，大量经济学家开始持续不断地将微观经济学和宏观经济学合二为一进行研究。由于有效的经济分析必须建立在对微观经济分析基本要素（即那些寻求改善其状况的单个家庭和企业）的行为研究基础上，因此经济学家极力建立用于宏观经济模型的微观经济基础。

此外，经济学家还试图采用超高速计算机，通过总结大量家庭和企业的行为，来模拟经济综合变量的行为。目前要评论这一行动的可能成果还为时尚早。但在宏观经济学领域，对原有模型的改进工作正不断取得进展。在始于2008年的全球金融危机期间发生的经济不稳定状况，已暴露了原有模型的不足。

## 大量经济学家开始持续不断地将微观经济学和宏观经济学合二为一进行研究。

### 区别何在？

当代微观经济学理论稳步发展，且并未脱离最早的有关物价确定方式的理论。而宏观经济学则基于现有理论可能无法解释的实证观察。如何解释那些异常现象，经济学家一直存在分歧。微观经济学没有意见相左的流派，所有经济学家对其核心理论达成了共识。但宏观经济学却并非如此。有关如何解释经济综合变量的行为方面，存在着多个学术流派，包括新凯恩斯主义或者新古典主义。不过，在过去一二十年间，这些分歧逐步缩小（Blanchard、Dell'Ariccia 和 Mauro，2010年）。

微观经济学和宏观经济学并非经济学的唯一独立子学科。人们普遍将计量经济学视为经济学的第三大核心研究领域。计量经济学是将统计和数学方法用于经济分析的一门学科。如果没有过去一百年间计量经济学研究的重大进展，现在微观经济学和宏观经济学所取得的很多重大分析结果也将无从谈起。■

G. 克里斯·罗德里格（G. Chris Rodrigo）是IMF研究部访问学者。

参考文献：

Blanchard, Olivier, Giovanni Dell'Ariccia, and Paolo Mauro, 2010, "Rethinking Macroeconomic Policy," IMF Staff Position Note 10/03 (Washington: International Monetary Fund).