

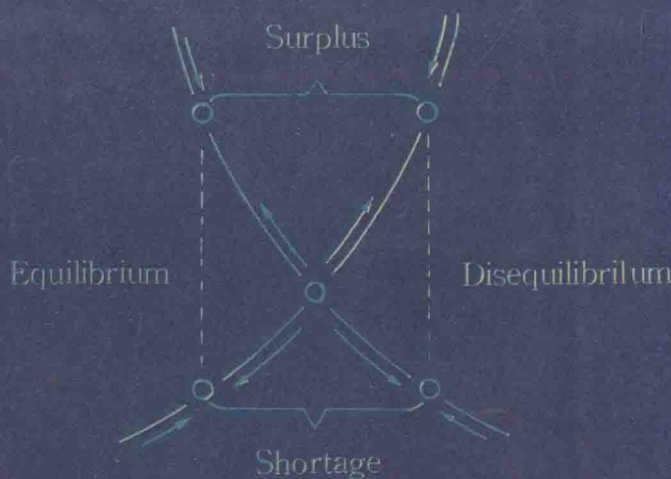
● 黃家驊

The Analysis of Equilibrium and Disequilibrium Market

Principle of Economics

市场均衡 与非均衡分析

现代西方经济学基本原理



福建教育出版社

市场均衡与 非均衡分析

——现代西方经济学基本原理

黄家骅

福建教育出版社

(闽)新登字 02 号

市场均衡与非均衡分析

——现代西方经济学基本原理

黄家骅

福建教育出版社出版发行

(福州梦山巷 27 号 邮编 350001)

福建医学院印刷厂印刷

(福州市交通路 88 号 邮编 350001)

850×1168 毫米 1/32 8.5 印张 205 千字

1993 年 12 月第一版 1993 年 12 月第一次印刷

印数:1—3,000

ISBN7—5334—1368—7/F·14 定价:7.85 元

如发现印装质量问题,由承印厂负责调换

目 录

导 言	(1)
上篇 微观经济学	(15)
第一章 市场理论	(17)
第一节 市场	(17)
第二节 市场需求	(21)
第三节 市场供给	(31)
第四节 商品市场的均衡与非均衡	(35)
第二章 消费者行为理论	(45)
第一节 边际效用分析	(45)
第二节 序数效用分析	(49)
第三节 消费者均衡	(53)
第四节 消费者均衡与非均衡变动	(57)
第三章 生产成本理论	(65)
第一节 生产	(65)
第二节 成本	(73)
第三节 收益	(87)
第四节 非均衡经济增长	(93)
第四章 厂商行为理论	(101)
第一节 厂商企业的形成	(101)
第二节 完全竞争下的价格与产量	(104)
第三节 完全垄断下的价格与产量	(109)

第四节	垄断竞争下的价格与产量	(114)
第五节	寡头垄断下的价格与产量	(117)
第五章	收入与分配理论	(120)
第一节	生产要素的均衡价格	(120)
第二节	工资、利息、地租、理论,收入的初次分配	(125)
第三节	收入再分配的平等程度	(134)
第四节	从微观到宏观:商品与劳动力两市场非均衡模型	(135)
下篇	宏观经济学	(148)
第六章	公共产品与政府财政	(150)
第一节	公共产品	(150)
第二节	政府对非均衡市场的干预	(158)
第三节	政府财政	(165)
第七章	货币银行与政府金融	(171)
第一节	货币的供给	(171)
第二节	货币的需求	(175)
第三节	政府金融与货币政策	(182)
第四节	非均衡市场的货币理论与操作	(186)
第八章	国民收入和两市场模型	(194)
第一节	国民收入的核算	(194)
第二节	国民收入决定的模型	(202)
第三节	商品市场和货币市场的均衡	(211)
第九章	失业、通货膨胀和经济周期	(220)
第一节	就业与失业	(220)
第二节	通货膨胀	(225)
第三节	失业与通货膨胀	(232)
第四节	周期性经济非均衡波动	(236)
第十章	开放条件下的总均衡	(243)

第一节	国际贸易的理论基础	(243)
第二节	国际贸易与国际收支政策	(253)
第三节	开放条件下的宏观均衡与非均衡	(258)
后 记		(267)

导 言

以 1776 年亚当·斯密的著作《国富论》发表为标志，西方经济学已有 200 多年的历史。为了从总体上把握西方经济学的产生和发展，必须理顺这门学科理论与分析方法的主要线索。本书以市场均衡与非均衡的分析为脉络，这是因为市场经济变量的波动始终表现出均衡与非均衡两种形态；众多的西方经济学家沿着均衡与非均衡的理论框架展开自己的理论思路；西方经济学各种教科书的篇章结构不同程度地应用了均衡或非均衡分析方法；所以，经济均衡与非均衡概念所包含的丰富内容，必然使它成为西方经济理论研究的中心。

均衡与非均衡理论分析的发展大致经历了早期均衡思想、一般均衡理论、动态均衡理论、来自非均衡的挑战、均衡与非均衡的综合、一般非均衡思想的发展这六个阶段。

一、早期均衡思想

亚当·斯密之前的经济学说史上就出现了朴素的均衡思想。在资本主义初期，重商主义就主张采取一系列措施，保持外贸进出口的有利平衡；重农主义的代表人物威廉·配第不仅确定商品价值是由劳动创造的，而且说明了利息由货币供求决定；法国重农学派的代表人物弗兰斯尼·魁奈以《经济表》为基础，最早说明了社会资本再生产和流通的过程，同时也构筑了生产与交换、货币与实物相互均衡的最初模型。至今西方经济学仍然把《经济表》作为现代局部均衡方法（如投入产出表）的先驱。

但是，只有在古典经济学家亚当·斯密那里，我们才看到比

较系统的均衡思想。虽然斯密没有以均衡方法来构筑他的理论体系,但在《国富论》中许多基本理论借助于均衡观点作为分析方法。在斯密对资本主义市场经济的理解中,既肯定了“看不见的手”对资源配置和差别利益的调节作用,又认为这种调节作用达到一种理论的、合符自然的状态;斯密区分了市场价格和自然价格,说明只有市场上商品供求一致时,其市场价格才会等于自然价格,这实际上是后来均衡价格的最早表述;斯密的三种收入决定论(工资是劳动的报酬、利润是资本的报酬、地租是土地的报酬),在后来演变为许多经济学家分析要素市场均衡价格的理论框架。因此,斯密的思想对于启发后来经济学家探究市场均衡机制是很有帮助的。

二、一般均衡理论

一般均衡理论经历了 19 世纪 70 年代到 20 世纪 30 年代的创建时期。这一时期在西方各国出现了形形色色的经济学流派,如以庞巴维克(Behmbawark)为代表的奥地利学派,以克拉克(J·B·Clark)为代表的美国流派,以杰文斯为代表的英国学派。他们不仅强调市场价格体系能够自行实现社会资源的均衡配置,而且将数学引入经济研究,为一般均衡分析找到了数学表达式;他们都广泛运用了边际分析法,按照边际报酬递减规律来确定市场交换的均衡规则,使一般均衡理论和方法都发生了重大变革。1874 年,洛桑学派的代表者和“边际革命”的奠基者列昂·瓦尔拉斯(Leon Walras)发表了《纯粹经济学要义》一书,以边际分析方法为基础,建立了一般均衡理论体系。其中包括:(1) 均衡市场的完全竞争性,即市场上存在着众多的买者和卖者,任何一个市场的参与者都不能控制价格的变动,而只能接受既定的价格而追求最大效用的获得。(2) 均衡市场的约束性与调节性。瓦尔拉斯认

为市场参与者将根据价格的变动而调整自己的供给或需求。在整个交换过程中,供给和需求相互受到对方的约束,使得一组价格中供给总值必须与需求总值相等,形成恒等式 $\sum P_i D_i \equiv \sum P_i S_i$, 这就是后来所称的瓦尔拉斯定律。根据这项定律,市场交换中假如存在某种商品的超额需求,必定有这种商品的超额供给与之对应。这是因为市场交换系统可以通过价格的涨落,调节商品的超额供给或超额需求,并使之达到一般均衡。(3) 均衡市场的信息充分性。瓦尔拉斯认为市场均衡并不是一蹴而成的,而是通过“试错法”而连续近似地逼近均衡解。为此,他设想市场中存在一个“拍卖商”来组织商品的交换。拍卖商作为“喊价者”而提供给买卖双方充分的市场信息,经过一次又一次的试错,使“拍卖商”喊出的价格逐渐接近供给与需求双方的意愿,并促使市场超额供给一方降低价格,市场超额需求一方升高价格,最终归拢双方的意愿,价格与供求数量逼近均衡点。(4) 均衡市场的普遍性。均衡的实现不仅限于商品交换市场,同时,瓦尔拉斯认为一般均衡还应包括生产的均衡、资本市场的均衡,和货币市场的均衡,它们各自价格与数量的一致性构成了瓦尔拉斯一般均衡分析的对象。但是,瓦尔拉斯均衡体系中并没有解决市场内在和谐性和稳定性问题,后来的经济学家致力于这方面研究才加以解决。

意大利经济学家维尔弗雷多·帕累托对市场均衡中如何获得社会福利的最大值进行了研究。瓦尔拉斯体系中未能解决商品效用的可测性问题。帕累托则在序数效用论的基础上找到了两种商品生产、交换、分配的均衡条件,赋予社会资源配置的最优效率以现实可能性和条件。

英国的阿弗里德·马歇尔在 1890 年出版了《经济学原理》一书,他集上述学派和供求论、节欲论、边际效用论、边际生产力论、生产费用论之大成,创立了以均衡价格为核心的理论体系。马

歇尔均衡理论的特点是：(1)、局部均衡理论。瓦尔拉斯的一般均衡理论是以所有商品的价格互相联系和影响为前提，而马歇尔的局部及均衡理论则是就某一商品本身的供求来说明该商品价格的决定，并不考虑其它有关商品价格的变动及其影响。(2)、自动均衡决定。马歇尔肯定自由竞争能够使市场自动地达到均衡。他说：“这种均衡是稳定的均衡；这就是说，如果价格与它稍有背离，将有恢复的趋势，象钟摆沿着它的最低点来回摇摆一样”^①。因此，需求价格与供给价格的不一致将会消弥，在函数图象上需求曲线与供给曲线将最终确定他们之间的交叉点上，即形成均衡价格。(3)、均衡力量决定。马歇尔对供求力量的决定因素进行分析，确定边际效用决定需求价格及其变动，生产成本决定供给价格及其变动，二者通过供求共同决定价格。(4) 均衡分配理论。马歇尔认为分配的问题就是国民收入如何分割为各生产要素的份额问题。工资、利息、地租和利润是各生产要素的供求相均衡的价格，同样，他又将供求效用同边际生产力论和生产成本论结合起来，提出了边际生产力决定各生产要素的需求价格、生产成本决定其供给价格（土地除外）的理论。马歇尔的均衡价格理论仍然是当代西方微观经济学的基础。

三、动态一般均衡思想

瓦尔拉斯的一般均衡思想和马歇尔的局部均衡理论都是一种静态的、稳定的均衡分析，因而存在较大的理论与现实的差距。1933年美国的张伯伦和英国的罗宾逊分别出版了《垄断竞争论》和《不完全竞争经济学》，指出完全竞争的非现实性，垄断竞争和不完全竞争更具有普遍的实际意义，从而修改了马歇尔均衡学说

^① 参见马歇尔：《经济学原理》下卷，商务印书馆1965年版，第31页。

的历史前提。1939年，英国经济学家希克斯发表《价值与资本》，在吸收前人的一般均衡理论的基础上，建立了动态一般均衡理论。他的理论特色主要是：（1），以“边际替代率”代替“边际效用”的概念，来说明消费者均衡的稳定条件。消费者在市场上面临的是一组商品的组合，而不是一种商品价格组合。商品价格的变动将产生收入效应和替代效应，影响消费者选择的偏好次序。消费者必须使他所购买的任何两种商品的价格比等于这两种商品的边际替代率，这也是希克斯所强调的个人均衡条件，但这仅仅还是静态一般均衡的实现机制。（2）引入时间因素并把它与经济动态过程联系起来。希克斯提出三个基本观念：星期、计划、预期。“星期”是动态分析的时间单位；“计划”是消费者和厂商根据市场情况而作出的支出或生产的安排；“预期”是因为引进时间与计划安排之后，经济变量是在时间中进行的，消费者和厂商要对未来不确定的风险因素进行估量、调整。通过引进这三个基本观念，希克斯把所谓的“经济动态”解释为从一个“暂时的均衡”到另一个“暂时的均衡”所形成的一连串“均衡移位过程”。它们之间的关系是：人们采取的计划是当前价格和对未来价格的预期而定；如果第一个星期确定的价格不能使市场供求相等，价格就得调整；当前价格的变化又会引起计划的改变，结果又引起供求的变化，最后使之达到均衡。

四、来自非均衡的挑战

均衡经济理论作为现实世界的模拟，是为了说明资本主义自由放任的资源配置方式的协调性，是为了证明供给与需求、价格与成本在市场机制作用下可以互相吻合。然而，均衡经济理论所赖以实现的几个极端性假设前提随着历史的发展越来越显现出它们的非现实性和非普遍性，同时更多的经济学家对传统的均衡经

济理论提出了怀疑和挑战。

传统的均衡经济理论都建立在这几个假设的基础上：(1)、市场上存在一个作为信息中心和价格制定的“喊价者”；(2)、不存在任何限制价格变动的非经济力量；(3)、所有的交换都是按均衡价格进行的；(4)、只有数量信号存在并发生作用。显然，这些假设都带有或多或少的非现实性。在现实市场中，除了交易所以外，根本不存在一个掌握各方面供求状况的“喊价者”。即使在比较完善的市场，建立了所谓“经济信息中心”一类的附属设施，也不能为市场参与者提供所必需而完备的经济信息。这是因为获得信息的非充分性（人们不可能获得所有供求状况的信息）、非及时性（信息的传递具有滞后的倾向）、非真实性（信息传递过程常常被扭曲和偏误）和稀缺性（获得信息要花费成本），就不能满足市场参与者对现实经济运行过程观察和决策的需要，也不能协调各个市场按真正的供求情形而调整交易数量，这样，就不能保证均衡价格的实现。况且，三十年代的经济大萧条也粉碎了均衡经济实证的的有效性，使均衡经济理论面临着完全不同的现实基础了。

正是在均衡经济理论和它的现实应用发生双重危机的时候，英国经济学家约翰·梅纳德·凯恩斯接受了来自现实世界的挑战，于1936年发表《就业、利息和货币通论》一书，一反均衡经济理论的传统，开创了非均衡分析的理论思路与模型，形成了所谓经济学上的“凯恩斯革命”，对后继的经济学研究产生了久远的影响。凯恩斯应用非均衡的分析方法提出了与均衡经济模式全然不同的理论思路，他的研究线索是将市场分为几个组成，分别考察不均衡的势态。

(1)、商品市场。传统的商品市场理论是以均衡价格论为基础，确定商品的总供给量等于商品的总需求量。按照生产费用理论，一年中新的商品总量，在价值上表现为工资、利息、地租、利润的

国民总收入；而且该年商品的总需求量，表现为国民总支出。当国民总收入与国民总支出相等时，商品市场全部结清，既不存在超额供给，也不存在超额需求。凯恩斯认为可以把商品市场分为两个方面，从供给方面看，国民收入等于消费加上储蓄（ $Y=C+S$ ）；从需求方面看，国民收入等于消费与投资的和（ $Y=C+I$ ）；均衡的条件应该是 $S=I$ ，即储蓄与投资相等。然而，凯恩斯认为，由于存在边际消费递减的倾向，储蓄在收入中的比例有增大的趋势，造成了消费需求的相对不足，因而商品市场是结不清的，这是他采取非均衡分析的着眼点。

（2）劳动市场。均衡经济学派认为，劳动的需求价格（由劳动的边际生产力决定）必然与劳动的供给价格（由劳动的边际费用决定）相等，劳动市场价格波动相应形成均衡工资水平和均衡就业量，结果就只有“充分就业”而不存在“非自愿性失业”，即使发生失业，那也只是“自愿失业”或“摩擦性失业”，所以劳动市场是可以出清的。凯恩斯则认为一国的总就业量取决于“有效需求”，即总供给价格与总需求价格相一致时对总就业量的需求，如果发生失业、或“非自愿性失业”，那就是“有效需求”不足的结果。在整个社会经济中，劳动超额供给的存在，并不能诱发商品市场超额需求与之对应，结果只能使劳动市场结不清。

（3）、货币市场。在均衡经济流派那里，已经实现商品市场和劳动市场的充分就业均衡，货币就只是交换的媒介，而不是对经济活动产生作用的经济变量。凯恩斯把货币当作影响收入的变量，而不仅仅是交换的媒介。凯恩斯与传统货币理论的深刻分歧是：第一，均衡经济流派认为，利息是储蓄等待所带来的报酬，储蓄和投资决定利率；凯恩斯认为货币的需求取决于人们对货币流动偏好的心理状态（交易动机、谨慎动机、投资动机），货币的供给取决于中央银行，货币市场的均衡方程为 $M_1 + M_2 = L_1(y) +$

$L_2(r)$), 这样, 利息就不是使储蓄与投资趋于均衡的价格, 而是使货币供求相等的一种价格。第二、均衡经济学派认为, 通过利息率的上涨和下跌的调节作用, 将使储蓄最终用于投资, 储蓄和投资趋于一致, 这种说法不能解释为何“有效需求”不足的现实。凯恩斯认为储蓄取决于边际消费倾向, 投资取决于资本边际效率。由于边际消费倾向递减, 收入的一部分转化为储蓄, 造成总需求的“漏出”, 又由于在技术装备条件不变的情况下, 随着社会投资的增加, 资本的边际效率会趋于递减, 这是造成投资需求不足的原因。第三、凯恩斯又认为, 利息率的高低决定于货币供求的差距, 增加货币量可使贷款利率下降, 但利率对货币供给的弹性并不充足。因为利息是人们对货币流动偏好报酬, 人们放弃流动偏好, 就是为了取得利息报酬, 利率由于灵活偏好而具有粘性。这就使得资本边际效率下降要快于利息率, 并构成资本市场不能出清, 社会有效需求不足的内在原因。

总之, 根据凯恩斯对商品市场、劳动市场、货币市场的分析, 均衡经济流派所追求的市场和谐状态是不现实的。由于经济主体的无理性、经济运行过程的不稳定、经济变量的非弹性, 处处都表现出失衡的存在。凯恩斯革命, 当然包括经济研究方法的革命, 凯恩斯所主要论述的小于充分就业的均衡, 实际上是非均衡分析方法的开端。

五、均衡与非均衡的综合

凯恩斯的《通论》发表以后, 影响了西方整整一代经济学家。凯恩斯确立了宏观经济学的主要框架为各国资产阶级政府干预经济提供了理论依据, 然而, 在凯恩斯以后的长时间内, 西方经济学并没有沿着他所确立的非均衡研究方向继续开拓, 人们只能找

到现代经济非均衡分析的只言片语。在 60 年代前,微观经济学基本上承袭了瓦尔拉斯和马歇尔的均衡价格论,并以此来证明厂商和消费者的合理行为。凯恩斯的继承者虽然拓展和充实了宏观经济理论,但仍然试图以一般均衡分析来建立宏观经济学。因此后凯恩斯主义的理论特征是均衡与非均衡学说的综合,主要倾向上仍然认为市场是可以出清的。

以保罗·萨缪尔森(Paul·Samuelson)、托宾(J·Tobin)、索洛(R·Solow)为代表的新古典综合派(又称后凯恩斯主流经济学派),一直试图把传统的微观分析(即马歇尔的新古典均衡理论)与凯恩斯的宏观分析“综合”起来,用政府的需求管理弥补以往静态均衡分析的不足。他们的基本理论如下:

(1) 现代收入决定论,又称为汉森 45° 模型。1949 年汉森出版了《货币理论和财政政策》一书,提出了一个以 $C+I$ 与 45° 线相交的宏观均衡模型。后来萨缪尔森又写成《收入决定的现代理论》一书并对该模型进行修改,既继承了凯恩斯的有效需求理论的框架(即收入支出理论,边际消费倾向、资本边际效率,灵活偏好、货币数量等范畴),又揉进了马歇尔的均衡价格理论的基因,提出了新的宏观均衡模型,即:消费+投资+政府支出应等于国民总产值,即总需求等于总供给。在此基础上,新古典综合派肯定了古典学派关于充分就业均衡的合理性,其条件是市场变量如工资、价格必须具有弹性。新古典综合派认为,只是由于市场垄断力量的存在,使工资和价格失去了伸缩性,因而资本主义经济的常态不是充分就业均衡,而是小于充分就业的均衡。在这种情况下,必须借助于所谓的“内在稳定器”(政府税收和支出)来增加或削减 $C+I$ 的总量,就可以实现既无失业也无通货膨胀的充分就业均衡。

(2) 菲力浦斯曲线。在《通论》中,凯恩斯经过对三个市场

消费与储蓄和收入与投资关系的考察，已确定利息率对市场均衡的影响作用。但是，凯恩斯并没有同时地考察货币市场上利息率变化和商品市场收入水平变化的关系。而希克斯则通过 IS—LM 模型表明了商品市场与货币市场同时达到均衡时，投资与储蓄、货币供给与灵活偏好四个因素对收入和利息率的决定作用。这样就把利息率水平与国民收入联系起来了，克服了“汉森—萨缪尔森 45° 度模型”的缺陷，为政府干预经济时更好地结合财政政策与货币政策作了重要补充。然而，IS—LM 模型隐含了价格不变这一前提，把凯恩斯所强调的经济运行过程的“不确定性”和“预期”完全排斥了，使它脱离了货币工资、物价水平变动的现实性，也不能更好地照顾到政府所要面对的充分就业与物价稳定两个目标，这就使新古典综合派陷入了困境。在此同时英国经济学家菲力浦斯(A·W·Phillips)对失业与通货膨胀的关系提出了新的解释。新古典综合派对菲力浦斯关于通货膨胀与失业相互替代的观察结论作了进一步发挥，一方面从微观上考察成本变动和劳动力市场的结构，另一方面从宏观上寻求相机抉择的调控方法。但是面对 70 年代后的“滞胀”并存现实，新古典综合派的解释再次失灵了。

(3) 新古典综合派增长模型。凯恩斯当年所面临的急迫经济问题，使他只注意到短期非均衡的分析方法；他认为长期经济运行是不确定的，并排除了长期分析方法。新古典综合派注意到凯恩斯学说的这一缺陷，强调保持经济长期均衡发展的必要性，提出了一个国民经济长期均衡增长的模型，即著名的“哈罗德—多马”模型。英国经济学家哈罗德和美国经济学教授多马认为，凯恩斯关于投资与储蓄的均衡对就业量和国民收入均衡的决定，只是一种静态的均衡，没能说明长期动态发展这一均衡如何决定的问题。“哈罗德—多马”模型展示了 $G=S/C=S\sigma$ ，表明经济增长率

取决于储蓄增长率和资本与产量的比率。但是这一模型假定生产技术不变，那么就使劳动与资本的比例不变、资本与产量比例的不变，经济增长率就仅仅决定于储蓄增长率。如果既定的储蓄增长率所带来的经济增长率大于自然增长率，就会出现长期经济繁荣；反之，则出现长期经济停滞，只有当二者相等时，才能保证国民经济均衡增长。当然这种“均衡”只是一种极偶然的巧合，后来的新古典综合派经济学家索洛（R·W·Solow）和斯旺（T·W·Swan）就批评哈—多模型的均衡条件如“刀锋”那样狭窄，并针对这种缺陷提出了新古典学派增长模型。后一模型的特点是将凯恩斯的收入理论与新古典经济学的生产要素（资本和劳动）的微观分析综合起来，提出资本与劳动不同组合比例、边际劳动力递减、完全竞争三个假设条件。若技术和边际生产力不变，则全部国民收入等于资本收入和劳动收入的总和。也就是说，经济增长应取决于资本增长率、劳动力增长率以及技术进步影响作用。为此，新古典综合派认为，经济均衡增长的途径是在国家干预的条件下，通过市场机制的作用，实现资本与劳动、资本与产量的合理比率。

总之，上面所分析的三个方面大致说明了新古典综合派的理论出发点，虽然他们也补充和发展了凯恩斯的有效需求理论，将凯恩斯的静态短期分析引申为动态长期分析；但是，他们理论出发点的要旨是“综合”，主要理论观点都着力于将凯恩斯的小于充分就业下均衡理论纳入瓦尔拉斯和马歇尔一般均衡的框架，从而磨钝了凯恩斯关于非均衡分析的新意与创见。

六、一般非均衡思想的发展

第二次世界大战以后，资本主义曾在一段时间内经历了经济增长较快、失业人口较少、通货膨胀率低的“繁荣”，新古典综合