

MICROECONOMIC THEORY
BASIC PRINCIPLES AND EXTENSIONS

微观经济理论 基本原理与扩展

[第9版]

[美] 沃尔特·尼科尔森 (Walter Nicholson) 著

朱幼为 等译 宁向东 审校

微观经济理论：基本原理与扩展（第9版）向读者展现了一个全面、易懂的现代微观经济学的全貌。书中对所有主要经济理论的结论给出了清晰、直观的解释，并强调了对许多微观经济学问题都通用的数学模型。每章最后的“推荐阅读文献”和“扩展”部分介绍了许多专业文献中经常引用的高级文献和实证应用分析，有利于学生更好地了解和阅读专业性文献。

本版更新

- 在前九章里尝试改进并扩充了效用最大化和企业理论的基本内容
- 对有关需求理论的内容作了全面修订
- 对成本函数一章作了重要补充，集中讲述函数中各种投入之间的替代关系
- 拓展了利润函数概念
- 增加了大量计算实例穿插于各章中，用以讲述各函数模型的运用
- 与新增加的理论部分相匹配，新补充了大量的问题和数学实例

微观经济理论：基本原理与扩展（第9版）同时配有英文影印版

24

上架建议：经济学

ISBN 978-7-301-12289-1



9 787301 122891 >

定价：75.00元

经济学精选教材译丛

MICROECONOMIC THEORY
BASIC PRINCIPLES AND EXTENSIONS

微观经济理论

基本原理与扩展

[第9版]

[美] 沃尔特·尼科尔森 (Walter Nicholson) 著
朱幼为 等译 宁向东 审校



北京大学出版社
PEKING UNIVERSITY PRESS

北京市版权局著作权合同登记 图字:01-2006-4702

图书在版编目(CIP)数据

微观经济理论:基本原理与扩展(第9版)/(美)尼科尔森著;朱幼为等译.—北京:北京大学出版社,2008.5

(经济学精选教材译丛)

ISBN 978-7-301-12289-1

I. 微… II. ①尼… ②朱… III. 微观经济学-教材 IV. F016

中国版本图书馆CIP数据核字(2007)第200226号

Walter Nicholson

Microeconomic Theory: Basic Principles and Extensions, 9th edition

ISBN:0-324-27086-0

Copyright © 2005 by South-Western, part of Cengage Learning.

Original edition published by Cengage Learning. All rights reserved.

本书原版由圣智学习出版公司出版。版权所有,盗印必究。

Peking University Press is authorized by Cengage Learning to publish and distribute exclusively this simplified Chinese edition. This edition is authorized for sale in the People's Republic of China only (excluding Hong Kong, Macao SARs and Taiwan). Unauthorized export of this edition is a violation of the Copyright Act. No part of this publication may be reproduced or distributed by any means, or stored in a database or retrieval system, without the prior written permission of the publisher. 本书中文简体字翻译版由圣智学习出版公司授权北京大学出版社独家出版发行。此版本仅限在中华人民共和国境内(不包括中国香港、澳门特别行政区及中国台湾)销售。未经授权的本书出口将被视为违反版权法的行为。未经出版者预先书面许可,不得以任何方式复制或发行本书的任何部分。

本书封面贴有 Cengage Learning 防伪标签,无标签者不得销售。

(Thomson Learning 现更名为 Cengage Learning)

书 名: 微观经济理论:基本原理与扩展(第9版)

著作责任者:[美]沃尔特·尼科尔森(Walter Nicholson) 著 朱幼为 等译 宁向东 审校

策划编辑:张迎新

责任编辑:张迎新 张慧卉

标准书号:ISBN 978-7-301-12289-1/F·1633

出版发行:北京大学出版社

地 址:北京市海淀区成府路205号 100871

网 址:<http://www.pup.cn> 电子邮箱:em@pup.pku.edu.cn

电 话:邮购部 62752015 发行部 62750672 编辑部 62752926 出版部 62754962

印 刷 者:三河市欣欣印刷有限公司

经 销 者:新华书店

850毫米×1168毫米 16开本 38.75印张 953千字

2008年5月第1版 2008年5月第1次印刷

印 数:0001—5000册

定 价:75.00元

未经许可,不得以任何方式复制或抄袭本书之部分或全部内容。

版权所有,侵权必究

举报电话:010-62752024 电子邮箱:fd@pup.pku.edu.cn

纪念朱宝宪老师

(代译者序)

摆在大家面前的这本书,是《微观经济理论:基本原理与扩展》(第9版)的中译本。我是第6版的译者之一,但翻译那一版的工作,已经是整整十年前的事情了。那时,朱宝宪老师还健在,他是那次翻译工作的组织者和校对者。然而,遗憾的是,宝宪老师现在已经辞世了。尼科尔森的这本书,在美国是一本很有影响的教科书,在技术处理上比较经典,很有特色。朱宝宪老师以非常严肃的态度组织翻译了这本书,介绍给中国的众多学生和读者,让他们受益匪浅。因此,我来写这个代译者序,自然要借此机会来纪念朱宝宪老师。不过,为了不妨碍读者在选书的时候,因为我冗长的纪念文字而失去对这本书的兴趣,我还是将译者该说的话放在前面,简单介绍我对这本书和它应有读者对象的理解。

客观地说,尼科尔森的这本《微观经济理论:基本原理与扩展》确实是一本出色的教科书。它值得我们现在一版又一版、不厌其烦地翻译和介绍。即使是在今天教科书多如牛毛的情况下,我们仍旧可以说,《微观经济理论:基本原理与扩展》是一本卓尔不群的力作。在我看来,这本书主要具有以下几个鲜明特点,值得阅读。

第一,该书在选择内容上比较规整。尼科尔森教授始终坚守着经典理论的介绍与传达,不过,该书各版次间各章在结构编排上还是变化很大的,这反映了尼科尔森教授与时俱进的一面。比如,博弈论和有关信息经济学、政治经济学等内容,现在被放在了最后,是尼科尔森教授对经济学进化的一种表达,篇幅虽短却全面而深刻。

第二,该书是以训练学生专业能力为目标的教本。它使用稍有难度的数学来表述微观经济学的基本理念,介于初中级和高级之间。这对于训练经济学专业学生用数学语言表达经济学观念,进而有逻辑地处理和分析经济学问题,非常有好处。该书乍看上去有大量的数学推导,但实际上懂得一些微积分和初等概率的知识,就足以看得懂。只不过中间的推导过程显得繁复和枯燥,容易把人赶走,关键是要有耐心。可以说,如果读者是想学到经济分析的本领,则这种严密推导的训练是必不可少的。只有这样,才能培养自己解析问题背后深层逻辑的功力,从而将定性分析手段上升到定量分析的高度。

第三,该书还为读者的进一步学习搭建了必要的桥梁。我第一次读到本书第5版的时候,是十几年前在美国进修学习的阶段,该书附文中有关经典文献的介绍,以及程度较深因而被放到“扩展”部分的内容,让我受益良多。这部分内容对于理解更为经典深刻的微观经济学理论有很大帮助。这是我深有体会的。

由于以上提及的,以及更多我未提及的特点,这本书直到目前仍是美国各主要大学使用的微观经济学教科书之一,因此,也适合我国众多经济学相关专业的学生阅读,特别是那些准备报考数量经济学相关专业研究生或准备出国留学的学生。当然,对于其他方面的人士,通过阅读这本书,基本上可以全面了解现代微观经济学,并理解经济学家为什么经常会用数学手段来交流思想,用数学语言来描述逻辑和分析经济问题。

做完了规定动作,以下就是自选动作时间了。我想用下面的篇幅来回忆本书的最早译者,已经英年早逝的朱宝宪教授。《微观经济理论》(第6版)的翻译者,除了朱宝宪老师,还有吴洪老师(宝宪老师的夫人),以及我当时的同事张顺明、刘智勇和我,共五个人合作完成。我们为了这本书花费了很多力气。记得我自己在那一年的整个寒假,前后共三个月(包括春节)都在进行翻译。并且,由于电脑故障,个别章节甚至翻译了两遍。可以说,这本书留给我的记忆是深刻的。宝宪老师当时一直在强调,要细致认真,因为这是一本教科书,而教科书,学生们是要一个字一个字来读的。应该承认,由于我们做得很认真,所以时隔多年,北京大学出版社还来找我翻译第9版。

坦率地说,当北京大学出版社的编辑找到我,希望由我来翻译新版《微观经济理论:基本原理与扩展》的时候,我并没有很痛快地答应下来,而是犹豫再三。原因很简单,我现在的研究工作所占时间太多,已经不可能像十年前那样静下心来逐字逐句地进行翻译工作了。而事实上,至少在我看来,翻译比写作还要难。既要尊重原著者,又要用恰当的中文重新表达,那是需要大量的时间投入、“费力不讨好”的工作。但是,这本书则完全不同,因为这里面有朱宝宪老师的因素。

朱宝宪老师和我既是师生、同事,也是很好的朋友。他去世的时候,我们相识整整二十年。宝宪老师和我的师生缘,始于1986年。那时,他刚刚从北京大学经济系研究生毕业,来到清华大学新恢复的经济系教书。我那时是清华大学经济系复建后的第一批学生。朱宝宪老师和黎诣远老师共同教授我们的西方经济学,黎老师教微观,宝宪老师教宏观。后来,宝宪老师还教授了“现代西方经济学流派”课程。记得当时使用的是一本《宏观经济学与新宏观经济学》的英文课本,由当时教授我们“货币银行学”的德国教授介绍到国内。宝宪老师在若干年后,曾经将这本书的主要部分翻译成中文,作为校内教学参考书,使我们受益良多。1988年,我本科毕业,论文研究的题目是“现代宏观经济学中非均衡理论的发展脉络”,宝宪老师是我的指导老师。1990年,我研究生毕业后留校教书,又与宝宪老师有过很多合作,共同编写过一些书。

应该说,这20年来,宝宪老师虽然年长于我,属于老师一辈,但他在我心目中却更像朋友。我从他的身上学习到了很多东西。也许是由于他的信任,我还可以在闲谈中听到他的一些心里话,一些对于人和事的看法,这对我的世界观影响很大。另外,宝宪老师的上进与勤奋,正像深深地影响了无数其他学生一样,也大大地影响和改变了我的一些思想方式和行为习惯。

朱宝宪老师是在学术上相当用功和勤奋的人,他也有着比较高远的学术理想和认识。但他的起点并不高。他是文革前的老初中生,属于被“四人帮”耽误的一代。我记得他曾经给我们讲过他初中毕业之后在食品厂里做面包的故事,而那正是应该在高中里读书的时光。他只能在工作之余自学。1978年恢复高考之后,宝宪老师考入了北京经济学院;1982年,他接着考入了北京大学经济系攻读研究生,师从范家骧先生。今天在中国经济学界非常活跃的刘伟、平新乔、王一江、朱善利等人,当年都是他攻读研究生时的同班同学。宝宪老师常常与学生们津津乐道的,就是他的这些同学在读书时如何用功。他对有平新乔和王一江这些闯荡美国名校的同学,更是自豪不已。

宝宪老师是一个很温和而谦逊的人。他所说的,更多的是他的那些同学和朋友的故事,而不是他自己。但从我对他的观察,他也一样竭尽全力地工作,甚至更加努力。只不过,由于自身身体健康状况的客观限制,在工作内容和结果上,他的努力往往不太为人所知。

在我看来,宝宪老师当然是一个优秀的研究者,他关于中国公司并购的经验研究发表在《经济研究》等国内顶级学术期刊上。但他对校内外学生影响最大的,是他关于西方经济理论的学术传播。从前面提到的《当代西方经济学流派》(译自《新西方经济学》,为清华大学经管学院教材,未公开出版),到我们现在这本《微观经济理论:基本原理与扩展》,以及其他的如《国际经济学》《金融市场》等书,都是这方面的例证。在今天看来,翻译作品似乎并不重要,学术的含金量似乎并不高。但在20年前,甚至10年前,在国际学术交流还没有成气候,“海归”还没有大量返回国内的情况下,让年轻学子能够及时地看到原汁原味的西方经济学教科书,则相当重要。从我自己的体会来看,作为一名教师,能够向国内的学者和学生快速传达最好的经济学著作,可能远比自己写一两篇研究论文更重要得多。我想,宝宪老师大概就是基于这样的一种心态,在履行着他作为教师的使命。

北京大学出版社请我来组织翻译这本书,我不能拒绝,因为这是一个多少可以告慰一下宝宪老师在天之灵的机会。而对于我,则可以多少弥补一点遗憾,同时也算是做了一件纪念朱宝宪老师的事情。本书的主要译者——朱幼为是宝宪老师的儿子,也是他的骄傲。至今,我还记得朱幼为进入清华附中“龙班”时,以及他考入清华大学经济管理学院时,朱宝宪老师兴奋与自豪的神情。我想,如果由朱幼为完成这项翻译工作,则是对宝宪老师的一个最大安慰,也是我愿意做,以及现在应该做的。我对朱幼为说,第6版的中译本是一个很好的基础,新增的部分需要你努力,如果翻译上有问题,我可以帮助你,你的妈妈吴洪老师肯定也可以帮助你。在我的鼓励下,朱幼为和他的同学一起完成了本书的主要翻译工作。其中,朱幼为翻译了1—4章、6—12章和15章,李硕翻译了13、14、16和17章,刘悦翻译了18—21章。我在进行校对的时候,感觉到译稿的质量还是很不错的,当然,这里面有很大程度要归功于吴洪老师的帮助。现在,译稿即将付梓,我想,宝宪老师如果在天有灵,看到朱幼为有了新的成绩,一定会感到更加欣慰。

宁向东

2008年3月于清华大学

经济管理学院

前 言

《微观经济理论:基本原理与扩展》(第9版)向学生展现了一个全面、易懂的现代微观经济学的全貌。书中对所有主要经济理论的结论给出了清晰、直观的解释,并强调了对许多微观经济学问题都通用的数学模型。另外,每一章最后的扩展材料中介绍了一些更高级的文献和实证应用分析,里面汇集了许多专业文献中经常引用的内容。希望这些扩展材料可使那些专业性文献更易于被学生所接受。

第9版的新变化

本版最主要的变化在前九章。在这几章里,我尝试改进并增加效用最大化和企业理论的基本资料。和以前各版相比,这一版的一个重要变化是在这一部分中使用了更加流畅且一致的符号。尽管微观经济学中还没有公认的“标准”符号,但相信引入的这些新符号会和我们当前在实践中使用的符号很好地兼容。本教材其他核心理论部分的变化主要包括:

- 对需求理论作了全面的修订,特别强调了支出函数以及从中推导出的包络关系。
- 对成本函数作了补充,集中讲述了函数中各种投入之间的替代关系。
- 拓展了利润函数概念,对于如何从该函数推导出投入需求函数作了细致的分析。
- 增加了大量的计算实例穿插在各章中,用来讲述各个函数模型的运用。

后十二章在该教材第8版中变动较大,在这一版也作了大量重要的补充,主要有:

- 引入了一些一般均衡下简单的两种商品模型。
- 补充了信息经济学的部分内容,特别是增加了关于委托-代理问题与和谐激励机制的设计方面的内容。

- 增加了诸如耐用品、风险厌恶、劳动力市场均衡等问题的短文。
- 与新增加的理论部分相匹配,新补充了大量的问题和数学实例。

为使用本书的教师准备的完全重新修订的和本版教材配套的教辅资料有:

- 由本书作者编写的《习题解答》(*Solutions Manual*)。该书包括书中全部问题的讲解和解答。
- 由本书作者编写的《试题库》(*Test Bank*)。
- 最新推出:与该教材配套的PPT幻灯片,由东伊利诺伊大学(Eastern Illinois University)的Linda Ghent制作。该PPT文档提供了每一章的内容框架,可供教学使用。

致谢

在本版的修订过程中,我从很多人那里得到了富有建设性的意见,他们是:

Ronald S. Warren, Jr., 佐治亚大学
Nick Feltovich, 休斯顿大学
Steven Marc Goldman, 加州伯克利大学
Gerald M. Lage, 俄克拉荷马大学
Ying Chi Chan, 约翰·霍普金森大学
Carrie Meyer, 乔治·梅森大学
Stephen Morris, 耶鲁大学
James J. Murphy, 马萨诸塞大学
Norman K. Thurston, 杨百翰大学

正是这些审阅者建议我对本书前几章中出现的数学符号作一些修改,并花费更多笔墨在消费和收益函数的概念上,我接受了这些很好的建议。当然,不足之处仍由本人承担全部责任。

这个版本是本书第一次由 Cengage Learning 出版集团出版发行,我和他们的合作相当愉快。在保证该书按期完成和修改完善新版数学符号两件事上,我真是欠了苏姗·斯马特(Susan Smart)极大的人情。我也知道录入这样一份手稿是一项相当烦琐的工作,但是 Shepherd 公司的录入员 Michelle Livingston 干得十分出色,他从我那乱七八糟的手稿中准确无误地找到了我所要表达的内容。既要使全书行文简练又要通俗易懂似乎是难以调和的两个目标,但负责编辑本书的 Justin Klefeker 成功地实现了这两点。我想我们合作的结果是相当令人满意的。Cliff Kallemeyn 在本书修订的过程中也作出了很大贡献,他发现了几处由于我粗心而犯下的错误。同时感谢康奈尔大学的 David Stapleton,他一直在为本书编写学习指导,以及肯纳索州立大学的 Brett Katzman,他编写了在线习题。

和以往一样,我的阿默斯特学院的同事和学生也为新版修订做了大量的工作。Frank Westhoff——这本教材最忠诚的使用者,尽管已经阅读本书多年,依然再次认真地通读并指出很多有待改进的地方。今年,Steve Rivkin 也加入了评审教员的队伍,而我从他的慧眼中也确实获益良多。还有,除了以前的那些学生(Mark Bruni, Eric Budish, Adrian Dillon, David Macoy, Jordan Milev, Tatyana Mamut, Katie Merrill and Jeff Rodman)仍然为本版付出了大量心血以外,这次 Doug Norton 也加入其中,大部分新增的“扩展”是他帮我完成的。

最后,特别要再次感谢我的妻子 Susan,她眼见着我的 18 个版本的微观经济学教材一部部问世,再不敢幻想家中还能保持整洁(也许还有,不再幻想我还能心绪安宁)。我的四个孩子(Kate, David, Tory 和 Paul)都过着快乐又富足的生活,只是他们完全没有微观经济学的知识。现在,他们的下一代(Beth, Sarah 和 David)正在慢慢长大,我想他们的求知欲可能会更加旺盛,至少渴望知道我献给他们的这些书都是讲什么的。

沃尔特·尼科尔森

目 录

第 1 篇 引 言

第 1 章 经济模型	3
1.1 理论模型	3
1.2 经济模型的验证	4
1.3 经济模型的一般特征	5
1.4 经济价值论的发展	8
1.5 新近的发展	15
小结	16
推荐阅读文献	16
第 2 章 最优化的数学表达	18
2.1 一元函数最大值问题	18
2.2 多元函数	22
2.3 弹性的通用定义	24
2.4 多元函数的最值问题	26
2.5 隐函数	29
2.6 包络定理	30
2.7 条件极值	34
2.8 约束条件下的最大化问题中 的包络定理	40
2.9 不等式形式的约束条件	40
2.10 二阶条件	42
2.11 齐次函数	49
小结	51
练习题	52
推荐阅读文献	54
扩展:二阶条件和矩阵代数	54

第 2 篇 选择与需求

第 3 章 偏好与效用	61
3.1 理性选择定理	61
3.2 效用	62
3.3 交易与替代	65
3.4 数学推导	70
3.5 特定偏好的效用函数	73
3.6 多种商品的情形	77
小结	79
练习题	79
推荐阅读文献	81
扩展:特殊的偏好	81
第 4 章 效用最大化与选择	84
4.1 效用最大化与快速计算	84
4.2 利他主义与自私自利	84
4.3 初览	85
4.4 两种商品的情形:图形分析	86
4.5 n 种商品的情形	89
4.6 间接效用函数	95
4.7 一次总付原则	95
4.8 支出最小化	98
4.9 支出函数的性质	100
小结	102
练习题	102
推荐阅读文献	105
扩展:预算份额	105

第5章 收入效应和替代效应	109
5.1 需求函数	109
5.2 收入变化	111
5.3 一种商品价格的改变	112
5.4 消费者的需求曲线	116
5.5 补偿性需求曲线	119
5.6 对价格变化反应的数学进展	122
5.7 需求弹性	126
5.8 消费者剩余	132
5.9 显示性偏好与替代效应	136
小结	139
练习题	140
推荐阅读文献	142
扩展:需求概念和价格指数的衡量	142
第6章 商品间的需求关系	146
6.1 两种商品的情形	146
6.2 替代品与互补品	149
6.3 净替代品与净互补品	151
6.4 多种商品情形下的替代关系	152
6.5 组合商品	153
6.6 家庭生产的产品成分与隐含 价格	156
小结	159
练习题	159
推荐阅读文献	161
扩展:对需求关系的简化和二步预算 模型	162

第3篇 生产与供给

第7章 生产函数	167
7.1 边际生产力	167
7.2 等产量图和技术替代率	170
7.3 规模报酬	174
7.4 替代弹性	177
7.5 四种简单的生产函数	179
7.6 技术进步	183

小结	187
练习题	187
推荐阅读文献	190
扩展:有多种要素投入的生产函数	190
第8章 成本函数	193
8.1 成本的定义	193
8.2 成本最低的投入选择	195
8.3 成本函数	201
8.4 成本函数和成本曲线的移动	204
8.5 短期和长期的区别	214
小结	221
练习题	221
推荐阅读文献	224
扩展:成本函数的对数变换	224

第9章 利润最大化	227
9.1 厂商的性质与行为	227
9.2 利润最大化	228
9.3 边际收益	231
9.4 作为价格接受者的厂商的短期 供给	235
9.5 利润函数	238
9.6 利润最大化与要素投入需求	243
小结	249
练习题	250
推荐阅读文献	252
扩展:利润函数的应用	253

第4篇 竞争性市场

第10章 竞争性价格决定的局部均衡 模型	257
10.1 市场需求	257
10.2 供给反应的时间	260
10.3 极短期定价	261
10.4 短期的价格决定	262

10.5	供给曲线与需求曲线的移动: 图形分析	267
10.6	市场均衡的数学模型	270
10.7	长期分析	272
10.8	长期均衡:成本不变的情况	273
10.9	长期供给曲线的形状	276
10.10	长期供给弹性	278
10.11	长期均衡的比较静态分析	279
10.12	长期生产者剩余	282
	小结	285
	练习题	285
	推荐阅读文献	288
	扩展:总需求及其估计方法	288
第 11 章	应用竞争分析	292
11.1	经济效率与福利分析	292
11.2	价格控制与短缺	295
11.3	税收负担分析	297
11.4	贸易限制	300
	小结	304
	练习题	304
	推荐阅读文献	307
第 12 章	一般均衡和福利	308
12.1	完全竞争的价格体系	308
12.2	关于一般均衡的简单图形 模型	309
12.3	比较静态分析	318
12.4	一般均衡建模及要素价格	320
12.5	一般均衡价格的存在	321
12.6	完全竞争的效率	329
12.7	斯密的看不见的手的假说	329
12.8	帕累托最优	329
12.9	生产的有效率	330
12.10	混合生产的有效率	334
12.11	竞争性价格与效率——福利 经济学第一定理	336
12.12	偏离竞争的假设	339
12.13	分配	340

小结	345
练习题	346
推荐阅读文献	349
扩展:可计算的一般均衡模型	349

第 5 篇 不完全竞争模型

第 13 章	垄断市场模型	355
13.1	进入的壁垒	355
13.2	利润最大化与产出选择	357
13.3	垄断与资源配置	361
13.4	垄断、产品质量和耐用性	364
13.5	价格歧视	366
13.6	通过价格计划产生的二级价格 歧视	370
13.7	垄断管制	372
13.8	垄断的动态观点	375
	小结	376
	练习题	376
	推荐阅读文献	379
	扩展:最优价格计划	379
第 14 章	不完全竞争市场的传统模型	382
14.1	同质寡头下的定价	382
14.2	产品差别	390
14.3	进入	394
	小结	400
	练习题	400
	推荐阅读文献	403
第 15 章	博弈定价模型	404
15.1	基本概念	404
15.2	博弈论的纳什均衡概念	405
15.3	一个博弈的例子	406
15.4	纳什均衡的存在性	408
15.5	囚徒困境	411
15.6	两时期博弈	413
15.7	重复的博弈	415
15.8	静态博弈中的定价	417

15.9 进入、退出与策略	420
15.10 进入与不完全信息	423
15.11 信息不完全下的博弈	425
小结	430
练习题	431
推荐阅读文献	434
扩展:策略替代与互补	434

第6篇 要素市场定价

第16章 劳动市场	439
16.1 时间的配置	439
16.2 劳动供给的数学分析	442
16.3 市场的劳动供给曲线	446
16.4 劳动市场均衡	447
16.5 工会	452
小结	455
练习题	455
推荐阅读文献	458
第17章 资本市场	459
17.1 资本与回报率	459
17.2 回报率的决定因素	461
17.3 厂商对资本的需求	466
17.4 投资决策的折现值方法	468
17.5 跨期的最优资源配置	472
小结	477
练习题	477
推荐阅读文献	480
附录 复利的数学计算	480

第7篇 不确定性、信息和外部性

第18章 不确定性和风险厌恶	489
18.1 概率与期望值	489
18.2 公平赌博与期望效用假说	490
18.3 冯·诺伊曼-摩根斯坦定理	492
18.4 风险厌恶	494

18.5 对风险厌恶的度量	496
18.6 不确定性情况下进行选择的 状态偏好法	501
小结	506
练习题	506
推荐阅读文献	509
扩展:资产组合理论和风险定价	509

第19章 信息经济学

19.1 信息的性质	515
19.2 信息的价值	516
19.3 信息与保险	518
19.4 道德风险	519
19.5 逆向选择	522
19.6 委托与代理关系	527
19.7 所有者—管理者关系: 数学分析	529
小结	532
练习题	533
推荐阅读文献	535
扩展:搜寻的经济学	536

第20章 外部性与公共品

20.1 外部性的定义	539
20.2 外部性与配置无效率	541
20.3 处理外部性问题的方法	544
20.4 公共品的特征	547
20.5 公共品和资源配置	549
20.6 公共品的林达尔定价	553
小结	555
练习题	555
推荐阅读文献	557
扩展:减少污染	558

第21章 政治经济学

21.1 社会福利标准	560
21.2 社会福利函数	563
21.3 阿罗不可能性定理	565
21.4 直接投票与资源配置	567

21.5 简单政治模型	569	扩展:投票方案	578
21.6 代议制政府	571		
21.7 寻租行为	573	“请回答”部分简明答案	581
小结	575	奇数题号的习题答案	587
练习题	575	常用术语表	595
推荐阅读文献	577		

第 1 篇

引 言

第 1 章 经济模型

第 2 章 最优化的数学表达

第 1 篇仅包括两章内容。第 1 章分析了经济学家建立经济行为模型的一般方法。第 2 章回顾了用以建模的数学工具,这些重要的数学工具将在以后的每一章中反复用到。

第1章 经济模型

本书的主要目的,就是向大家介绍一些经济学中最重要的模型,经济学家通过这些模型来解释现实中的消费者和厂商的行为。这些模型是经济学一切领域研究的中心,所以有必要首先弄清楚这类模型需要满足什么样的条件,以及构建模型的基本框架是什么。本章的目的就是通过对一些基本概念问题的概述,来回答以上问题,这些基本概念问题决定了经济学家研究问题的基本方法。

1.1 理论模型

现代经济是一个很复杂的实体。成千上万的厂商从事着千百万种商品的生产,千百万人从事着各种职业,并各自决定着购买哪些商品。以花生为例,人们必须适时收获花生,并且用船运到加工厂制成花生酱、花生油、脆花生和许多其他的花生食品。接下来,加工厂还必须确保它们的商品能够适量地运到成千上万的零售点,以便满足消费者的需求。

要想描述这些花生产品市场的所有细节特征是不可能的,所以经济学家的办法是对十分复杂的现实世界进行抽象,以建立能抓住其“本质”的合理但简单的模型。就像道路图虽然没有标明每一栋住宅或每一片草地的具体位置,但它仍然是很有用的。同样,花生市场的经济模型也很有用,尽管它没有记录下花生经济的每一处细节。在本书中,我们将研究那些得到最广泛应用的经济模型。我们将看到,虽然我们将复杂的现实世界作了很大程度的抽象,这些模型仍然能够捕捉到所有经济行为中所共有的许多本质特征。

在自然科学与社会科学中人们都广泛运用着模型。在物理学中,“完全”真空或者“理想”气体是科学家用简化方法研究真实世界的一个抽象模型;在化学中,原子或者分子的概念也是物质结构的简化模型;建筑学家使用图样来设计建筑物;电视修理工利用电路图来寻找问题所在。经济学家的模型也具有同样的功能,这些模型表明个人决策的方式、厂商行为的方式,以及个人与厂商相互作用建立市场的方式。