

管理

MANAGERIAL

经济学

上海财经大学出版社

骆品亮◎编著

ECONOMICS

阳澄湖大闸蟹与包子
超女的赢利模式
装修的学问
到底喝了几瓶啤酒
EVD Jr Britannica
公共品的诱导机制
中国反垄断任重道远
博弈与人生
需求弹性与调价策略

MANAGERIAL
CONOMICS

骆品亮◎编著

F270
680

管理经济学

MANAGERIAL
ECONOMICS

 上海财经大学出版社

图书在版编目(CIP)数据

管理经济学/骆品亮编著. —上海:上海财经大学出版社, 2006. 8

ISBN 7-81098-676-7/F · 623

I. 管… II. ①骆… III. 管理经济学-高等学校-教材 IV. F270

中国版本图书馆 CIP 数据核字(2006)第 058391 号

☐ 特约编辑 王 征

☐ 封面设计 路 静

GUANLI JINGJI XUE

管 理 经 济 学

骆品亮 编著

上海财经大学出版社出版发行
(上海市武东路 321 号乙 邮编 200434)

网 址: <http://www.sufep.com>

电子邮箱: webmaster@sufep.com

全国新华书店经销

上海市印刷十厂印刷

上海望新印刷厂装订

2006 年 8 月第 1 版 2006 年 8 月第 1 次印刷

700mm×960mm 1/16 26.25 印张 471 千字

印数: 0 001—3 000 定价: 34.00 元

内容提要

管理经济学是一门研究企业在动态变化的经营环境中如何使用有限资源进行有效管理决策的应用性经济学科。这些管理决策可能会与顾客、供应商、竞争对手、替代者、协作厂商或企业内部组织有关。本书系统地阐述管理经济学的基本理论方法及其在企业管理决策中的实际应用。

全书共十二章。

第一章 阐述管理经济学的研究内容与研究方法；

第二章 分析需求的影响因素与需求弹性；

第三章 分析D—S模型及其在市场政策评价中的应用；

第四章 介绍成本分析及其在生产决策中的应用；

第五章 归纳市场结构的基本类型；

第六章 比较分析了竞争与垄断市场的绩效差异；

第七章 分析市场力量在定价决策中的具体实施；

第八章 从博弈论的角度分析企业的策略互动行为；

第九章 分析寡头产量博弈与价格博弈，以及具有差异化的垄断竞争厂商的竞争策略；

第十章 分析经济外部性对市场效率的破坏及其纠正机制；

第十一章 研究信息不对称与激励机制设计问题；

第十二章 阐释经济规制和反托拉斯政策。

本书适合于各种层次的读者阅读，包括MBA、经济管理类教师与学生、企事业单位管理人员、职业经理人等。

前 言

经济学家有价值的学术观点,既不可能产生于书斋里的冥思苦想,也不可能产生于忙忙碌碌而毫无思考的实际工作,而只能产生于扎实理论同艰苦实践之间的结合。

——薛暮桥

在管理经济学教科书琳琅满目的二十一世纪,要写作《管理经济学》是需要有相当勇气的。可是,写作一本适合于我国 MBA 阅读的《管理经济学》的愿望一直埋在我的意识深处,从二十世纪末到本世纪初,世纪的重压排山倒海般使我不敢有丝毫松懈。

海尔公司有一个著名的管理命题,那就是:如何让石头在水中浮起来?其答案是速度!快速运动的惯性终于使石头浮出水面!事实上,10 余年来,我从来没有停止对管理经济学的思考,使自己在知识爆炸的时代尚能跟上潮流。记得我国经济学界泰斗、已故经济学家陈岱孙先生曾经这样阐释经济,经济即“经世济民”。可谓一语道破天机。窃以为,陈老的本意在于告诫我们,学习西方经济学应本着为我所用的宗旨;而不是动辄搬出西方经济学一套成熟的理论模型或运行模式,对中国经济体制改革和企业改革实践评头品足。今天,我们说经济管理研究要“上天入地”也好,“顶天立地”也好,无非是希望经济理论研究能望西方前沿经济理论研究之项背;而经济理论研究又要从中国的改革开放实际出发。毛泽东一贯反对八股文。我们也应该抵制那种“脚踩蓝天、头顶大地”的腾云驾雾般的学术研究风气。我认为,这对于构建“中国经济学理论架构”是至关重要的。

应该说,管理经济学的基本脉络还是比较清晰的,不外乎充分竞争市场理论、市场力量、不完全市场三条主线;而其理论架构也比较成熟,包括需求分析、成本分析、市场均衡分析、市场力量来源与实施、竞争与博弈、外部性、信息不对称等。最近的一些教材还将员工薪酬、公司治理、公共管理、资本预算、风险投资纳入管理经济学的范畴。但是,认真阅读国外管理经济学的经典名著,如曼斯费尔尔德(Mansfield)、平狄克(Pindyck)、克雷普斯(Kreps)、波叶斯

(Boyes)、赫兹契(Hirschey)、方博亮(Png)等人编著的教科书及国内同类教材,发现实际上适合我国 MBA 阅读的管理经济学教科书并不多。

首先,许多管理经济学教科书是微观经济学的翻版。管理经济学与微观经济学的一个重要区别在于:微观经济学是基于理性假设推断经济行为的,微观经济学本质上是决策经济学;而管理经济学更多地从“行为反映了内在驱动因素”的视角,分析这些决定因素对经济主体决策行为的影响。因此,如果说微观经济学具有更强的解释性,那么,管理经济学则具有更强的应用性。

其次,目前,管理经济学经典教科书的应用案例的主角大多是跨国巨头,立足于无边界的全球化经营环境及游戏规则界定比较规范的法律世界。了解这些跨国巨头的策略行为是很有必要的,但是移植到国内企业便会出现“水土不服”。很多学生过于关注跨国巨头的行为并刻意模仿,动辄微软模式、丰田模式,结果常常出现“眼高手低”。同时,这些应用案例具有明显的角色特征,一般是从跨国公司的角度分析的,比如“肯德基如何进入中国”;而我们更关心的是诸如“中式快餐如何与肯德基竞争”或“海尔如何走向世界”之类的问题。应该说,本土化案例研究至今还是国内同行需要重点突破的,在这一点上可以说是任重道远。

再次,最近 10 年来,与管理经济学密切相关的信息经济学、网络经济学、合同理论、卫生保健经济学、传媒经济学等都取得许多重要进展,而当前的教科书基本上是以 20 世纪 80 年代以前的经济学理论基础为基石,未能及时反映这些理论进展在企业经营决策中的应用。

带着这些批判,我登上复旦大学 MBA 讲台。迄今为止,我已为复旦大学 MBA(包括 MPAcc 及深圳班)讲授《管理经济学》10 余届。我讲授《管理经济学》的一个基本风格是,从来不拘泥于某一本教材的理论体系,而是吸纳了诸多权威教科书理论脉络中的亮点;与时俱进,不断更新讲义与案例,总是试图反映最鲜活的事件。经长时间积累,在几易其稿的 MBA《管理经济学》课件的基础上,加上本人 10 余年来在应用经济学(特别是产业组织理论)领域的部分研究成果与心得感悟,编撰出版《管理经济学》,旨在对推进具有中国特色的管理经济学研究和教学哪怕只有一点点的积极意义。

我个人觉得,本书的特色在于:

第一,视角新颖。本书在经济全球化背景下,从管理经济学的理论进展出发,吸纳博弈论、信息经济学、委托代理理论、规制经济学的前沿知识,系统阐述管理经济学的基本原理,侧重于探讨管理经济学基本原理对我国企业经营决策的应用性。

第二,结构体系有新意。全书共12章。第一章,列举实例阐释管理经济学的研究内容,归纳管理经济学的研究方法,并分析利润最大化原则。第二章,分析需求的影响因素、需求弹性及其应用,着重阐述如何测度VIP卡的经济价值。第三章,论述D—S模型,这是管理经济学的核心模型,并基于D—S模型评价市场政策。第四章,转向经济活动主体——企业,介绍了成本的基本概念和成本在规模调整中的应用,着重介绍了规模经济性与范围经济性的概念与应用。第五章,归纳市场结构的基本类型,阐述企业如何在市场竞争中做大做强。第六章,比较了竞争与垄断市场的绩效差异,扼要论述了针对市场力量的公共政策。第七章,论述市场力量在定价决策中的实施,介绍了成本加成定价、价格歧视及非线性定价策略。第八章,从博弈论的角度分析企业的策略互动行为。作为策略行为理论的应用。第九章,阐述寡头产量博弈与价格博弈,以及具有差异化的垄断竞争厂商的竞争策略。第八章和第九章构成本书的一项内容创新。第十章,分析经济外部性对市场效率的破坏,归纳应付外部性的方法,并分析公共产品的提供机制,这部分内容成为本书的又一项内容创新。第十一章是本书的主要创新,研究信息与激励问题,包括逆向选择的解决方法、DIY与外包决策、绩效评价机制、委托代理模型、多任务代理模型等。第十二章,阐述经济规制和反托拉斯政策。

本书按48课时设计章节。在具体教学中,建议课时安排如下:第一章,3学时;第二章,6学时;第三章,3学时;第四章,3学时;第五章,3学时;第六章,3学时;第七章,6学时;第八章,6学时;第九章,3学时;第十章,3学时;第十一章,6学时;第十二章,3学时。

(3)理论与实际紧密结合,规范分析与案例分析有机结合。本书的理论体系脉络清晰,基本模型深入浅出,模型结果的经济学意义直观。本书的许多案例(特别是专栏中的微型案例)都是作者平时的积累,有些是作者创新灵感的结晶。本书的许多微型案例来自生活,具有实用性、趣味性、独到性的特点,比如:装修的学问、如何鉴定大闸蟹、到底喝了多少瓶啤酒、超女的盈利模式、公共品诱导机制……

在本书付梓之际,我要特别感谢我的博士论文导师、复旦大学首席教授,复旦大学管理学院名誉院长、美国麻省理工学院名誉教授、加拿大麦克马斯特大学名誉博士郑绍濂先生数十年来的言传身教及关怀;在他的鞭策下,我逐渐从学术论文惟上的研究风格转向学术论文和学术著作并重的落地生根式的研究轨道上来。韩夫子说:“师者,之所以传道授业解惑也”。对我等而言,“教学是天职,科研是本分”。因此,传播管理经济学的基本理论方法也是所有应用

经济学研究者的职责和重任。

我要感谢香港大学商学院陶志刚教授、白重恩教授、潘意刚教授,美国华盛顿大学奥林(Olin)商学院马丁·克利普斯(Martin Cripps)教授,美国西密执根大学周惠中教授,美国爱荷华大学王成教授,在与他们的共同教学、合作研究及学术讨论中得到的启迪及他们提供的对我颇有启发的学术资料。我要感谢复旦大学管理学院芮明杰教授、郁义鸿教授、项保华教授、余光胜副教授、付焯副教授及其他同仁们,他们对我在研究、教学上的热心帮助和学术讨论,使我获益非浅。我还要感谢我的研究生余林徽、陈连权等人帮助我查询部分学术资料,以及上海财经大学出版社王永长编辑的辛勤劳动。此外,王征老师对本书的详细审阅,并提出许多中肯的建议,在此一并表示感谢。

由于作者本人水平有限,书中肯定存在许多值得商榷的观点,祈望读者和同行不吝赐教。

骆品亮

2006年3月30日于上海复旦书馨公寓

目 录

内容提要	1
前言	1
第一章 导论	1
第一节 什么是管理经济学	1
第二节 管理经济学的分析方法	9
第三节 利润最大化原理	15
第二章 需求分析	27
第一节 个体需求	28
第二节 市场需求	36
第三节 需求弹性分析	47
第四节 微型案例	62
第三章 D—S 模型	68
第一节 供给分析	68
第二节 市场均衡分析	74
第三节 市场政策评价	80
第四节 微型案例	87
第四章 成本分析	96
第一节 短期成本分析	97
第二节 长期成本分析	107
第三节 成本分析应用	115

第五章 市场结构与市场力量	126
第一节 市场结构	126
第二节 市场力量	135
第三节 微型案例	142
第六章 竞争与垄断	157
第一节 完全竞争	157
第二节 垄断厂商	161
第三节 耐用品垄断	169
第四节 垄断链问题	171
第五节 垄断的社会成本	174
第七章 垄断定价	185
第一节 垄断定价基本原理	185
第二节 价格歧视	192
第三节 非线性定价	200
第八章 策略行为	210
第一节 博弈论基本原理	210
第二节 市场进入遏制	228
第三节 微型案例	237
第九章 寡头与垄断竞争	256
第一节 寡头厂商	256
第二节 垄断竞争	270
第三节 微型案例	273
第十章 经济外部性	295
第一节 外部经济效应与市场效率	295
第二节 经济外部性的解决方案	303
第三节 公共产品	310
第四节 微型案例	318

第十一章 信息与激励	326
第一节 信息不对称.....	326
第二节 组织架构设计原理.....	342
第三节 委托代理基本模型.....	359
第四节 微型案例.....	364
 第十二章 经济规制	 373
第一节 反托拉斯与政府规制.....	374
第二节 经济规制.....	384
第三节 微型案例.....	390
 参考文献	 404

第一章 导 论

第一节 什么是管理经济学

一、一个管理决策实例

在阐述管理经济学(Managerial Economics)是什么之前,我们首先考察一个航空公司如何应对燃料价格上升的管理决策实例。20 世纪 80 年代末期,在伊拉克入侵科威特后,航空燃料的价格大幅度上升。面对燃料成本上升对营运的负面影响,美国合众航空公司提出了 3 种解决思路:一是提高机票价格以抵消成本的上升压力;二是减少某些市场中的每日航班数量;三是与燃料供应商签订长期合同,在今后两年内以某一固定价格购买航空燃料,并使机票价格达到能收回这些成本的水平。

在系统学习管理经济学的基本原理之前,你对上述三种方案做怎样的直观评价?

首先,合众航空公司的决策目标是清晰的,即规避成本上升风险,牟取长期利润最大化(而不是市场份额最大化,这一点很重要。目标不同,决策方案也就大相径庭)。

其次,需要对各个候选方案的利弊做详尽分析,包括方案的短期效应与长期效应。从短期看,调高机票价格可谓立竿见影,在乘客来不及调整交通方式的选择及更换航空公司的情况下,乘客对合众航空的机票价格比较缺乏敏感性,提高机票价格可以将成本上升的风险转嫁给消费者。但是,从长期看,除非所有航空公司均提高票价,否则,合众航空公司单方面提高机票价格将使其市场份额萎缩,如果销量减少的负面效应超过毛利(Margin)增加的正面效应,那么,合众航空将损失长期利润。

读者可以联想 2005 年上半年上海出租车的涨价预案。面对国际原油市场价格的节节攀升,上海出租车行业推出涨价预案:将起步价涨至 11 元(原来

起步价为 3 公里/10 元,10 公里以内单价 2 元;之后单价 3 元),实际上等价于将原来的起步价 3 公里/10 元改变为起步价 2.5 公里/10 元。但是,随着私家车的迅速发展及上海公共轨道交通的逐步完善,老百姓对出租车价格已非常敏感,该方案立即遭到各利益相关者的强烈反对。在当时,可以预见,如果调高出租车价格,将本已处于白热化竞争状态的上海出租车行业(至 2005 年,上海市内出租车已达 5 万余辆)的竞争更趋势激烈。最后以上海市政府对出租车补贴而告平息(2006 年 6 月,因顶不住油价上涨的压力,起步价还是调整为 3 公里/11 元)。

而减少某些市场的航班数量,从短期看,可以提高这些市场航班的上座率,降低每个座位应分摊的间接成本(如停机费、机械师及飞行员的薪金等),提高每座位每公里旅程的利润贡献;另一方面,人为制造航空服务资源的稀缺性,在需求基本不变下减少供给,造成乘客竞争将导致机票价格上升,补偿燃料价格上升的追加成本。但是,从长期看,压缩航班数量后,可能导致需求得不到满足,甚至出现“座位超卖”的情况出现;如果竞争对手乘机增加航班,合众航空公司的市场份额也将受侵蚀。

方案三是一种有效的供应链管理(Supply Chain Management,简称 SCM)方式,短期内,合众航空公司可以规避燃料价格上升的风险;长期内,由于燃料价格的波动是无规则的,长期合同(Long Term Contract)使得合众航空公司与供应商形成互惠互利的长期共生双赢关系。这种长期供货合同的功能类似于期货合同,买卖双方事前厘定一项将来交割的交易合约,执行价格被事前锁定。

值得指出的是,当前我国原油市场价格随着国际政治风云而剧烈波动。究其原因,除了我国自产原油供需缺口较大外,还与我国原油采购体系过于单一(主要来自石油输出国卡特尔组织,即 OPEC)及未进入国际原油期货市场等因素密切相关。

通过上述简单实例,我们可以归纳管理决策的基本程序,如图 1-1 所示。首先,企业管理层应明确管理决策要实现的目标,对应于长期利润最大化与市场份额最大化目标的行动方案显然是不同的,损失毛利换取市场是实现销售目标的最常用方法。当然,在产品的不同生命周期阶段(Product Life Cycle,简称 PLC),目标通常是不同的。在导入期,许多企业的目标是启动市场,形成网络效应(Network Effect);而在衰退期,许多企业为实现战略转移而采取撤退战略。

接着,应群策群力找到制约决策目标实现的问题。在上例中,燃料成本上

升是制约合众航空公司持续盈利的主要原因。在许多管理决策中,定义问题是很困难的。比如,主题公园游客人数减少是什么原因造成的?是因为门票太贵还是因为缺乏宣传?抑或是因为主题公园缺乏有吸引力的游艺项目创新?

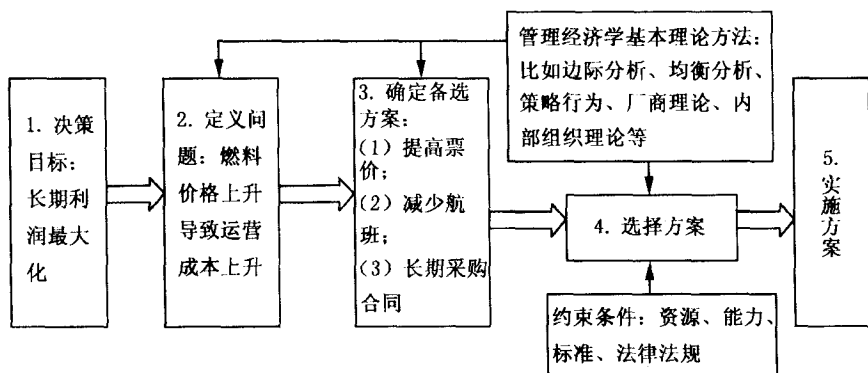


图 1-1 管理决策基本程序

之后,针对问题确定候选方案。本例中,合众航空公司制订了三个备选方案,即提高票价、航班资源的合理配置、长期合同。而在上述主题公园的例子中,可以设计降低门票(或表现为团体优惠、老年人与儿童折扣等方式)、加大宣传力度、增加游艺项目、改造设施、提供免费交通工具等诸多方案。

在此基础上,可以运用管理经济学基本原理,特别是最优化技术方法筛选方案,并确定最优行动方案。在方案选择中,需要考虑许多约束因素,比如企业已有资源与能力,是否符合行业技术标准,是否符合相关法律法规等。因此,行动方案的选择是一个具有约束条件的最优化决策问题,可以采用微积分、数学规划、博弈论等技术工具。我们在前面已对合众航空的三种方案之利弊进行详尽分析,认为合众航空公司应选择与供应商签订长期供货合同的方式来规避燃料成本上升的压力。

最后,贯彻实施最优行动方案。一个好的行动方案应具备较强的执行力;若未有效实施行动方案,再好的方案也只是空想。合众航空在选择长期采购合同后,应着力寻找合适的供应商,与之签订长期采购合同,并监督、维护长期合同的运作。在贯彻执行行动方案时,往往伴随着企业内部组织结构的变革,比如,成立执行行动方案的职能部门。以主题公园为例,如果执行增加游艺项目的行动方案,则应成立游艺项目创新的责任部门。

二、管理经济学的范畴

1. 管理经济学的主要内容

管理经济学是一门研究企业在动态变化的经营环境中,如何使用有限资源进行有效管理决策的应用性经济学科。这些管理决策可能会与顾客、供应商、竞争对手(包括潜在竞争对手与替代品)、协作厂商、或企业内部组织有关,如图 1—2 所示。

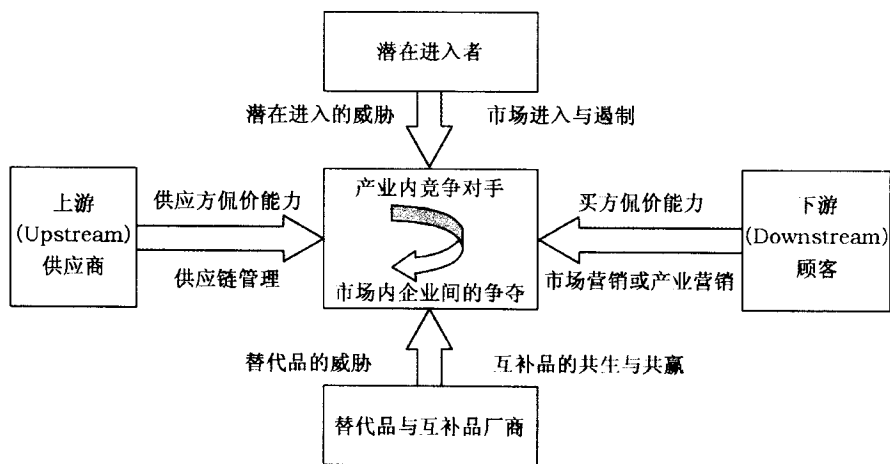


图 1—2 波特的五力模型(5F's)

传统经济学认为,企业经营决策应考虑成本(Cost)、竞争对手(Competitors)及顾客(Customer)3C要素。而产业战略学者米切尔·波特(Michael Porter)重构了企业战略环境分析模型,提出了五力(5 Forces)模型,即现有产业内竞争对手、潜在竞争对手、替代品厂商、处于价值链上游的供应商,以及处于价值链下游的买方^①。

比如,在2005年之前,家乐福、欧尚、易初莲花、麦德龙等是上海商业超级零售市场的在位竞争对手;而沃尔玛是潜在进入者;而传统的百货商店是替代品厂商;物流公司及贸易公司是供应商。再如,有线电视行业中,地方电话公司及空间有线等拥有传送专门节目和数据技术的运营商是潜在进入者。而铁路、客轮是航空服务的替代者;电子邮件、电话、短信是邮政服务的替代品。

^① 后来,战略学者们补充了第六力,即互补品厂商。互补品在网络产业至关重要,比如,硬件和软件、通信产品和电信运营商、EVD播放机与碟片之间就是互补品。

这些管理决策问题可以归纳为:第一,如何利用市场机会及企业内部资源寻求竞争优势?第二,拥有竞争优势的企业的决策行为(产量与定价决策、广告、质量选择、研发等);第三,如何保持竞争优势?这些管理决策具体包括:

- (1)进入什么市场?(目标市场选择及进入策略)
- (2)与已有产品应保持怎样的差异化?(产品定位策略及产异化竞争策略)
- (3)生产多少?是否外包?(产量决策及生产组织方式选择)
- (4)如何选择生产要素的组合?(成本最小化及生产效率问题)
- (5)如何为产品定价?(定价决策与价格竞争)
- (6)经营决策中如何考虑竞争对手的反应,如何影响竞争对手的行为以及如何应对竞争对手的策略变动?(竞争博弈及策略性行为)
- (7)如何消除信息不对称对本企业优质产品的负面影响?(信息与激励)
- (8)组织架构与内部治理机制设计,如何确定企业的横向边界与纵向边界^①?如何考核个人与部门的业绩?如何制订员工的薪酬结构?(激励与组织)

管理经济学的核心内容可由图 1-3 展示。在竞争市场中,企业不具有任何市场力量,只能是价格的接受者,根据自身成本结构进行生产;市场价格由市场总供给和总需求互动决定;供需模型即 D-S 模型是竞争市场的核心内容,市场通过价格机制配置资源。

在市场力量中,企业具有一定的市场力量,根据企业市场力量的大小可以分为垄断、垄断竞争与寡头等多种市场结构;垄断力量的实施与策略互动是市场力量的核心内容。

在不完全市场中,激励失灵导致经济外部性,出现成本转嫁或者利益外溢,市场机制配置资源出现低效率;而信息不对称导致劣币驱逐良币,最终导致市场崩溃。不完全市场呼吁政府管制部门的干预政策。

组织设计涉及自做或者外包(Make-or-Buy)这个古老的经济学话题;而经营者的薪酬合同是治理机制设计的核心问题。

2. 管理经济学与微观经济学的关系

如图 1-4 所示,按照研究方法划分,西方经济学包括实证经济学(Positive Economics)和规范经济学(Normative Economics)两大类。实证经济学

^① 水平或横向边界(Horizontal Boundary)是指企业运营的规模与多样化程度;垂直或纵向边界(Vertical Boundary)是指某一种活动较接近或较远离最终使用者,或者说企业在价值链活动中涉足的活动范围,在配件、设计、制造、销售等环节中做多少个环节。

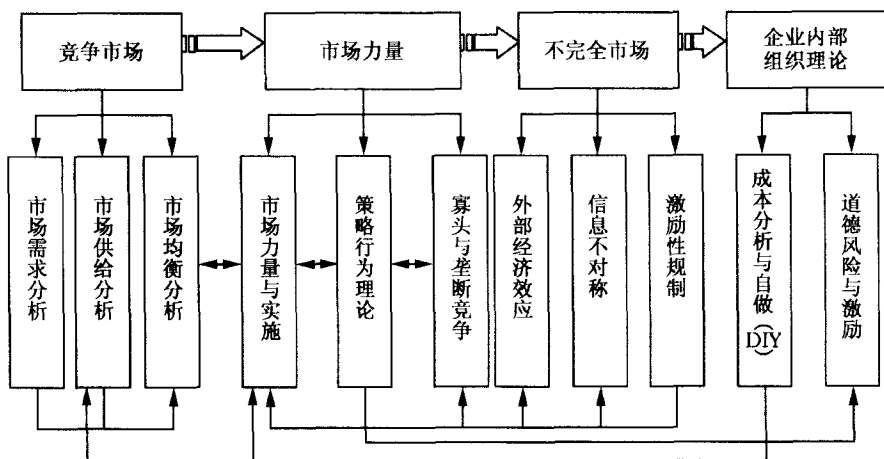


图 1-3 管理经济学的内容体系

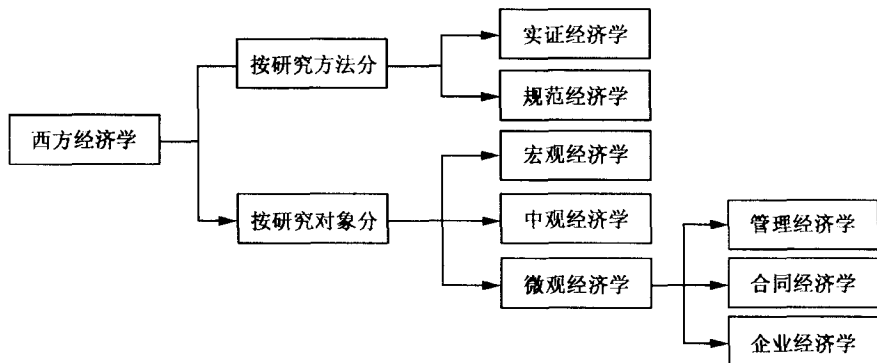


图 1-4 西方经济学学科体系

主要描述经济系统的运行现状与运行规律,回答“是什么(What It Is)”这个重要问题。比如,目前技术进步对我国经济增长的贡献有多大?目前我国智力资本是如何参与收益分配的?管理层收购(MBO)存在什么问题?联想是如何为其 PC 机制订价格的?等等。而规范经济学主要对经济系统应如何运行进行分析,回答“应该是什么(How Should Be)”这个更深层次的问题。比如,政府应如何实施国有资产从竞争性领域的退出机制?如何促进东部沿海地区的产业升级?如何培育产业集群内核心企业?联想应如何为其 PC 机定价?等等。显然,规范经济学离不开实证经济学,没有对经济系统的运行现状进行