

新世纪高校**经济学**教材译丛

Microeconomics of Market Failures

(法) 贝尔纳·萨拉尼耶 著
朱保华 方红生 译

市场失灵的微观经济学



上海财经大学出版社
Shanghai University
of Finance & Economics Press

新世纪高校经济学教材译丛

市场失灵的微观经济学

(法)贝尔纳·萨拉尼耶 著

朱保华 方红生 译

 上海财经大学出版社

图书在版编目(CIP)数据

市场失灵的微观经济学/(法)萨拉尼耶(Salaníe, B.)著;朱保华,方红生译. —上海:上海财经大学出版社,2004.5

(新世纪高校经济学教材译丛)

书名原文:Microeconomics of Market Failures

ISBN 7-81098-022-X/F·020

I. 市… II. ①萨… ②朱… ③方… III. 微观经济学-研究生-教材
IV. F016

中国版本图书馆 CIP 数据核字(2003)第 122347 号

- ☐ 选题策划 麻俊生
- ☐ 责任编辑 广林
- ☐ 封面设计 未名
- ☐ 版式设计 孙国义

SHICHANG SHILING DE WEIGUAN JINGJIXUE 市场失灵的微观经济学

(法)贝尔纳·萨拉尼耶 著

朱保华 方红生 译

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
上海第二教育学院印刷厂印刷
上海浦东北联装订厂装订

2004年5月第1版 2004年5月第1次印刷

890mm×1240mm 1/32 8.75印张 189千字
印数:0 001—4 000 定价:22.00元

图字:09—2001—380 号

Bernard Salanié

Microeconomics of Market Failures

© 2000 Massachusetts Institute of Technology

All rights reserved. No part of this book may be reproduced in any form by any electronic or mechanical means (including photocopying, recording, or information storage and retrieval) without permission in writing from the publisher.

Printed and bound in the United States of America.

本书根据麻省理工学院出版社 2000 年英文版译出
2004 年中文版专有出版权属上海财经大学出版社
版权所有 翻版必究

译者序

微观经济学不仅是现代经济理论的重要组成部分,而且也是相对形成严密逻辑体系的部分。与宏观经济理论的微观经济基础不同,微观经济理论的核心任务是论证 Adam Smith 的“看不见的手”的作用,说明市场机制作用的前提条件与理想结果。20 世纪的现代经济理论的最大成果之一就是利用现代数学方法论证一般均衡的存在性及其伴随一般均衡存在而衍生的福利经济学的基本定理。福利经济学的基本定理依赖 Pareto 最优或 Pareto 效率的概念,而基于 Pareto 最优概念的经济效率或市场机制的效率性又依赖完全竞争的前提。通常,微观经济理论的基本教程告诉我们,完全市场竞争理论是建立在价格接受者、同质商品、无市场壁垒、完全信息等前提基础之上的。只要完全竞争市场的条件不能得到完全满足时,市场机制就

难以实现 Pareto 最优,“看不见的手”的作用就将受到限制,从而出现市场失灵的问题。既然出现市场失灵时,完全竞争市场无法实现社会最优均衡,就需要考虑弥补市场失灵的问题。目前,国内基本上还缺乏系统讨论市场失灵问题的研究内容及其前沿进展的书籍,而 Salanié 的《市场失灵的微观经济学》恰好能有助于填补国内的市场失灵问题的专业书籍的空白。《市场失灵的微观经济学》的主要任务就是阐述市场失灵的原因、影响及其对策等问题,帮助读者掌握市场失灵的基本概念与分析方法,把握现代微观经济理论的规范研究的前沿领域的动向。

《市场失灵的微观经济学》讨论的内容涵盖集体选择、福利经济学、产业组织、不完备市场的一般均衡理论等,语言叙述简洁严密、直观可读,非常适合希望了解市场失灵的微观经济分析的读者阅读。本书介绍的集体选择理论不仅包括 Arrow 不可能性定理及其拓展,而且从 Arrow 不可能性定理的介绍延伸出 Rawls 的正义论、Sen 的自由主义、Nozick 历史主义等经济哲学问题。本书的集体选择的内容也有益于研究经济哲学的读者开拓视野。本书通过介绍社会选择与经济机制设计的实施问题讨论公共经济学涉及的公共财供给与外部性处理等基本问题。本书的产业组织理论部分包括不完全竞争市场的市场结构、数量竞争、价格竞争、垂直交易等基本内容,还结合信息经济学与博弈论的基本概念介绍现代产业组织理论的研究前沿。本书介绍的非凸经济与不完备市场理论是一般经济

学专业书籍很少详细介绍的内容,而不完备市场理论又是理解现代金融理论的基础之一。因此,本书也非常适合金融专业的读者阅读。本书的最大特色或许是在于解释集体选择、公共经济学、产业组织、不完备市场等不同领域间的有机联系。本书介绍的内容是现代经济学基础知识的延伸与扩展,不仅适合学过西方经济学的本科学生阅读,而且也可作为研究生层次的经济学教材使用。实际上,讨论社会选择、非凸经济与不完备市场的一般均衡等问题的专业文献基本上都是深奥的学术论文,一般性的入门读物不多,希望了解相关内容的读者也往往苦于找不到合适的读物。同时,财经类高等院校的现代经济学课程的教学安排也很难顾及社会选择、非凸经济等内容。然而,不理解社会选择、非凸经济等问题,就难以正确理解市场机制的作用。在一定程度上,本书非常有助于读者正确理解市场经济的作用范围、前提条件,客观评价市场机制与“看不见的手”的作用,也适合希望理解微观经济政策的读者阅读。总之,本书是难得的分析市场失灵的微观经济问题的优秀读物之一。

本书翻译工作的分工如下:朱保华翻译第1章至第4章及第13章,方红生翻译第5章至第12章,朱保华再根据原文统一译文的专业术语和文体。需要说明的是译文不仅改正了英文版的明显印刷错误,而且还根据汉语的习惯采用了直译与意译相结合的方式,对原文基本没有理解失误。毫无疑问地,限于译者的学识与能力,译文必然也

存在不妥之处,敬请读者宽容与指正。

朱保华

2004年4月于上海财经大学

前 言

正如书名所示,本书的主题是微观经济理论的市场失灵问题。因此,我希望本书能适合研究生或高年级的本科生阅读。本书源于我在巴黎国民经济统计研究所(Ecole Nationale de la Statistique et de l'Administration Economique)的讲义。1988年,Economica 以 Microéconomie; Les défaillances du marché 的书名出版了本书。很大程度上,本书得益于我的前辈,特别是(时间序)Jean-Jacques Laffont, Jean Tirole, Roger Guesnerie, Pierre - André Chiappori, Jean - Charles Rochet 和 Patrick Rey。感谢 Isabelle Braun-Le-maire, Elyes Jouini, Pierre - Francois Koehl, Jean Lainé, Guy Laroque, Laurent Linnemer, Tom Palfrey, Anne Perrot, Jérôme Philippe 和 Patrick Rey 对法文初稿的多次评论。当然,本书的不足与错误都应由本人负责。

目

录

译者序.....	1
前言.....	1
1 导论	1
1.1 基本定理	1
1.1.1 Pareto 最优	2
1.1.2 一般均衡	3
1.1.3 福利经济学的两个基本定理	3

2 ◀ 市场失灵与微观经济学

1.2 回顾假设	7
1.3 政府作用	9
文献	12

I 集体选择

2 偏好汇总	17
2.1 Arrow 定理	22
2.2 不可比基数偏好	29
2.3 可比序数偏好	30
2.4 可比基数偏好	31
2.5 结论	32
2.6 附录 A: Arrow 定理的证明	33
2.7 附录 B: 正义论	36
2.7.1 功利主义	36
2.7.2 Rawls 差别原则	38
2.7.3 最新发展	41
2.7.4 Nozick 历史主义方法	43
2.7.5 结论	44
文献	45
3 成本收益分析	48
3.1 福利测度	48

3.2 最优	54
3.3 次优	56
3.3.1 影子价格	56
3.3.2 非市场财	57
3.3.3 不完备市场	58
文献	59
 4 实施	 60
4.1 占优策略均衡	62
4.2 Nash 均衡	64
4.3 Nash 均衡的精炼化	71
4.4 Bayesian 均衡	72
4.5 附录 A: Gibbard-Satterthwaite 定理的证明 ...	73
4.6 附录 B: Maskin 定理的证明	77
文献	80

II 公共经济学

5 公共财	85
5.1 最优条件	87
5.2 实施最优	89
5.2.1 捐献均衡	90
5.2.2 投票均衡	91

5.2.3	Lindahl 均衡	92
5.2.4	个人化税收	93
5.2.5	计划程序	94
5.2.6	中枢机制	95
5.3	公共财性质	102
5.4	免费搭车的重要性	103
5.5	局部性公共财	105
5.6	附录:VCG 机制的特征	105
	文献	107
6	外部效应	109
6.1	Pareto 最优	110
6.2	实施最优	113
6.2.1	竞争均衡	113
6.2.2	配额	114
6.2.3	补贴减污	115
6.2.4	污染权	116
6.2.5	征税	118
6.2.6	生产者的一体化	119
6.2.7	补偿机制	119
6.3	管制价格还是数量	121
6.4	Coase 定理	124
	文献	126

7 非凸性	129
7.1 非凸性的影响	129
7.1.1 非凸偏好	129
7.1.2 非凸生产集	131
7.2 经济主体增加的凸性化	134
7.3 自然垄断的管制	137
7.3.1 边际成本定价	138
7.3.2 接受管制企业的次优定价	140
7.4 放松管制	148
文献	149

Ⅲ 产业组织

8 不完全竞争的一般均衡	155
8.1 三大难题	156
8.1.1 企业目标	156
8.1.2 价格标准化	157
8.1.3 利润的拟凹性	158
8.2 主观需求均衡	159
8.3 客观需求均衡	160
8.3.1 数量均衡	160
8.3.2 价格均衡	162
8.4 结论	163

文献	164
9 价格与数量	166
9.1 完全垄断	166
9.1.1 社会扭曲	169
9.1.2 避免扭曲	170
9.1.3 耐用财	172
9.2 价格歧视	174
9.2.1 一级歧视	175
9.2.2 二级歧视	175
9.2.3 三级歧视	177
9.3 寡头垄断	177
9.3.1 Cournot 寡头垄断	178
9.3.2 Bertrand 均衡	179
9.3.3 悖论解决法	180
9.3.4 战略替代与互补	185
文献	187
10 产品选择	189
10.1 定义	189
10.1.1 垂直差异模型	190
10.1.2 水平差异模型	190
10.2 产品差异与垄断	192

10.2.1 最优质量选择	192
10.2.2 不可观察的质量	193
10.2.3 产品种类的选择	195
10.3 产品差异与寡头垄断	196
10.3.1 最大差异原则	196
10.3.2 市场进入与产品种类	200
文献	208
11 长期进入与竞争	209
11.1 持续性与可竞争性	210
11.2 抢先行动	214
11.3 限价与掠夺	217
11.3.1 限价	217
11.3.2 掠夺	218
11.4 研究开发	219
文献	223
12 垂直交易	225
12.1 双重边际化	227
12.2 垂直约束的合理性	229
12.2.1 零售商努力激励	229
12.2.2 价格歧视	230
12.2.3 捆绑销售	231

12.2.4 降低价格竞争	232
12.3 不同方案比较	232
12.4 法律基础	234
文献	235

IV 不完备市场

13 不完备市场理论基础	239
13.1 一般框架	240
13.2 均衡的存在性	246
13.3 均衡的非效率性	247
13.4 生产均衡	249
13.5 国际贸易中的应用	252
13.6 结论	253
13.7 附录:名义资产	253
文献	255