

# 现代经济学 前沿专题

第一集

中国留美学者经济学会

CHINESE ECONOMISTS SOCIETY

汤敏 茅于軾 主编

商务印书馆

# 现代经济学前沿专题

第一集

汤敏 茅于軾 主编

商务印书馆

1996年·北京

XIÀNDÀI JINGJÌXUÉ QIÁNYÁN ZHUĀNTÍ

现代经济学前沿专题

第一集

汤敏 茅于軾 主编

---

商务印书馆出版  
(北京王府井大街36号 邮政编码100710)

新华书店总店北京发行所发行  
河北省香河县第二印刷厂印刷

ISBN 7-100-00814-X/F·84

---

1989年9月第1版	开本 850×1168 1/32
1996年4月北京第3次印刷	字数 266千
印数 5 000册	印张 11 1/4

定价：11.70元

# 序 言

到1978年,30年来中国因各种政治运动,大跃进、文革和其他因素的影响,以致文化、社会科学与经济发展缓慢,甚至退步。而自从1978年从事改革以后,学术思想与经济发展变化进步之快,亦是历史上的奇迹。中国留美研究经济与管理专业的年轻学者,合写了一部《现代经济学前沿专题》,这证明中国年轻学者研究世界先进科学的步子亦是惊人的快。我想在其他科学研究中,如物理学、化学、生物学、数学和各种工程科学,中国青年学者必有同样或更高的表现,这是中国进行改革后对现代化的一种超越的成绩。不少青年人对国家现代化的进展不够快表示不满,这是他们因中国落后与存在着不正之风而感到不耐烦所致,而他们自己的处境与成就,足以证明我们对中国改革与现代化的前景是应该乐观的。

本书内容很丰富,有些是一般介绍与评论性的论文,如对企业金融结构、企业理论、对策论、经济机制设计理论、交易费用经济学、递推规划、线性回归估计法与贸易和产业政策的介绍,有些是重于谈新的发展方向,谈贸易理论和增长理论、非线性经济学、发展经济学与南北贸易理论等。一般来说,论文的质量很好,对在中国受过微观经济学基本训练的同学与一般有理解力与分析能力的经济学人和社会科学研究者都是一本很好的参考书。以我个人而言,有些题目是我没有仔细研究过的,本书的论文作了很好的介

绍。有些即使在英文书籍中亦难找到更好的介绍。我诚意地把此论文集推荐给中国的读者阅读与参考。

研究经济学的主要目的,是了解一个或数个国家经济的运作,并寻求解决经济问题的有效政策。研究的出发点多半系现实的经济问题。微观经济学大部分,但非全部,起源于资本主义市场经济的问题。因为这些经济学家大多数住在资本主义国家,他们对本国的问题当然特别关心。当前中国经济学的发展,要以中国社会主义的经济问题为出发点。但何种经济学理论和方法适于用来观察和分析中国的经济问题,读者中可能会有不同的意见。受过现代经济学训练的学者,包括本论文集的作者在内,都认为现代经济学,尤其是微观经济学,可以在中国应用。这个观点有它的理由,我在写《中国经济》(南开大学出版社1985年出版)时,也尝试用上述的态度立论。现代经济学的理论与方法,当然有它的价值和用途,但应用它来分析中国经济,究竟有多少功效,意见不甚一致,但很少会有人说功效等于零。就是完全相信马克思经济学理论的,也会同意马克思理论有些地方,如价格问题和货币理论与古典经济学和现代经济学的一些基础观念颇相近。当然亦很少会有人说所有中国的经济问题,都能用现成的现代经济学全部满意地解释。我写《中国经济》的目的,象本论文集很多作者的目的一样,都是希望介绍现代经济学。我们觉得,对现代经济学先要加以了解,然后试用于分析中国经济问题,这样才会发现它的功能与缺点,才能将它改进。现代经济学,如本书作者的启示,是天天在修正与改良的。这样,经济科学才会有进步,利用它研究中国和全世界的经济问题,才会作出更好的分析,找到恰当的解答方法

我很敬佩与感谢本论文集的发起人与作者。他们为中国经济学的发展和中国的现代化,作了重要的贡献。这是本书的读者和留意中国历史的观察者都会一致承认的。我们为此祝贺本论文集

的主编和各位作者,并希望读者对他们多作善意的批评,使他们继续努力,将来对经济学与中国的现代化作更大的贡献。

邹至庄

于美国普林斯顿  
1989年3月31日

## 编者的话和内容简介

这本《现代经济学前沿专题》是由中国留美同学经济学会(CHINA YOUNG ECONOMIST SOCIETY)组织编写的。最初发动这一创议的是学会理事汤敏在第三次年会(1987年6月,密歇根大学)上提出来的,并立刻得到杨文艳和其他会员的热烈赞同。以后大家寄来了文章摘要,经筛选后我们邀请已经获得了博士学位或正在写博士论文的14位作者撰写了这一集。作者们在十分紧张的工作和学习间隙中挤时间完成了文稿,其中的每一个字都凝集着海外学子对祖国经济学发展和经济改革的关切心情。

应该说,国内改革10年来经济学的进展大大超过了改革前30年的成就。从经济学有关的杂志数量,每年发表的论文数目就可以说明,更不必说经济学文章所讨论的问题和文章的学术水平。特别是近年来许多中青年经济学家根据改革的经验,提出了一系列崭新的经济观点,这些观点对当前改革有着指导意义。其实,这里的不少问题在国外经济学的发展中都曾以不同的方式被提出过,而且积累了许多宝贵文献。引进他们思考问题的方法,借鉴他们的研究成果,对我国的理论研究和改革实践必有极大的帮助。所以现在缺乏的是沟通,是从学术语言到方法论上的沟通。而在美国留学经济、金融、管理专业的同学,正好可以起到桥梁作用。他们对经济学不但有了全面梗概的了解,而且各有专门的研究。尤其

是他们保持着对经济学最新发展的密切注意，同时又休戚相关地注视着国内的改革。由他们选择题目，介绍经济学的新进展到中国经济界来，必将大有裨益于我国的学术进展和经济改革。

西方的经济和社会随着战后国际经济新秩序的建立发生了很大变化。石油危机的冲击，日本、联邦德国和东亚的崛起，美国经济的衰退等现实问题，又对现存的经济理论提出了一个又一个的挑战。现代数学、物理学、计算技术以及社会科学的发展又为经济学的进展提供了新的可能。我们这个专集将着重反映这些新的信息，特别是80年代以来的新成果。在每一篇文章里作者把某一专题的历史背景，发展过程，各个学派的观点介绍给读者。文末还附有详细的参考文献索引。现代经济学文献浩如烟海，尽管每位作者都对本题目作了全面介绍，但即使是综述性的文章也涉及作者对文献的取舍与评价问题。有意深究的读者可进一步参阅原始文献，以便对原著者的立论和思路有更准确的把握。

我们还力求本文集既有一定的学术水准又比较通俗易懂。今天的经济学已成为一门从计量方法到逻辑演绎都有严密定义和形式要求的科学，它所用的数学工具也越来越艰深。这常使对现代数学了解不多的读者望而生畏。在本文集中我们侧重于介绍经济学家提出问题的方式和解决问题的方法，尽量少用艰深的数学，使稍具经济理论基础的读者就能看得懂。

在本书编辑过程中，我们得到留美同学经济学会上届会长陈平博士及现任会长孙涤博士的大力支持。除了本书撰稿人外，叶梦华博士、左小蕾、杨文艳、徐滇庆同学也参加了部分审稿工作，特别是邹至庄先生为本书写了序言，谨此表示衷心感谢。

下面我们将本集中12篇文章的主要内容及对我国经济意义作一简介。首先让我们提醒读者，任何一种理论的应用都有其特定的前提条件。这里可以用在美学习经济学的同学经常听到的一



个小故事来说明。

沙漠，正午，因为没有开罐工具，几个饥渴交困的学者正围着一堆罐头一筹莫展。于是一场研究如何用最简单的办法开启罐头的学术讨论会开始了。

物理学家首先发言：“给我一个聚光镜，我可以用阳光把罐头打开。”

化学家接着说：“我可以利用几种化学药剂的综合反应来开启罐头。”

“我的办法最简单，”经济学家说：“假如我有一把开罐刀……”。

故事近乎可笑，但包含重要的哲理。让我们记住其中的意义，来逐一介绍本集中的文章吧。

本文中集中第一篇文章的作者是钱颖一，他是本学会第二届会长。他在《企业理论》里介绍了近代企业理论的发展。除了1937年科斯发表了《企业的本质》一文，到70年代为止很少有经济学家研究企业的内部机制，以及不同组织形式对企业参与市场行为的影响。过去总以为企业追求利润是不必再去研究的自然特性。这种看法起源于资本家兼任经理的资本主义初期。但公司组织出现之后，经理是董事会的雇员，或者说，所有权和经营权分离。此时企业的内部组织变得复杂，而且影响企业在市场上的行为和其内部效率。文中介绍了三种企业形成的理论。第一是交易费用学说，认为如果没有交易费用，企业就没有存在的必要，企业内部的活动可以一笔笔地以市场交换的方式进行。所以企业是为了节约交易费用而存在。70年代出现了产权学派，他们认为企业内部需要监督，最高级的或最后的监督者由于可以获取企业的剩余收入而毋须别人来监督他们。第三种理论认为由于市场上的信息不完善而需要企业，企业内部的信息交换优于市场上的，企业的存在可以降低信息不完善引起的外部性效率降低。上述这些理论对于我国试图将

国营企业的所有权与经营权分离的活动，有重大的指导意义。文章还介绍了关于企业资本的结构(股份和债券)、经理报酬的确定、企业领导和职工合谋牟利、条条与块块的管理体制等问题的研究。钱颖一还曾在《知识分子》杂志上发表过介绍匈牙利经济学家科尔奈的学说的文章，对于科尔奈的软约束理论作过许多研究。

和上一题目密切有关的是单伟建写的《交易费用经济学的理论、应用及偏颇》。该文首先回顾了科斯的论点，但着重介绍了以威廉森为代表的交易费用学派以及他们的理论用于研究企业及其纵向联合、跨国公司和技术转让等问题的成果。他的理论深入到人的行为动机。由于人有损人利己的倾向，再加上经济环境的不确定性，使得交易费用上升，限制了市场的作用。企业内部利益是一致的，因此用企业内的行政隶属关系代替市场来配置资源的利用，可以减少交易费用。企业的扩大及兼并，就是将市场内化为企业以提高效率的过程。文中介绍了对美国铝矿和炼铝企业的研究，证实了纵向联合的理论分析。这一理论可对我国最近出现的各种形式的联合体的前途作出经济效益分析。对我国更有意义的也许是关于国际间资金流动和技术转让如何减少交易费用的讨论。最后作者分析了交易费用理论中存在的问题。最主要的一点是忽视了企业作为生产组织者的作用。企业之活力来源于它通过要素组合生产出价值，从而得到利润。降低交易费用只是达到企业目的的手段。即使在交易费用相同的条件下，企业仍因经营能力不同而有大有小，可见决定企业规模的除了交易费用外，还有其它更重要的因素。所以用交易费用理论解释有关企业的一切现象，难免失之偏颇。

单伟建是中国留美同学经济学会主办的刊物《中国经济论坛》(CHINA ECONOMIC REVIEW)的主编，该刊为一严格的学术性刊物，在全世界发行。

产权问题的核心是激励机制问题，例如公有制的产权关系下能否产生可以避免经济浪费的激励机制。对于这个问题作更一般讨论的就是本文集中田国强的文章《激励、信息及经济机制设计理论》。过去我国的经济政策，以及作为政策依据的传统经济理论包含一个严重的误解，即认为为了保证国家经济的顺利发展，必须限制甚至牺牲个人利益，因为它假定人们的利益是互相对立的。近10年来我国开放改革取得重大经济进展，同时自由经济的理论又大量地被介绍到中国来。在旧的误解还远没有完全消除的情况下又产生另一种误解，即以为在任何情况下通过自愿交换追求个人利益都能导致全社会经济效益的提高。但这两种看法都是片面的，尤其是前一种看法。事实上，一个富裕的社会一方面必须保护每个成员为了自身利益而进行公平竞争的权力，同时又要精心设计法律等措施来对付成本递减及可能产生的垄断，用税收来限制外部效应，提供共用商品并改进社会公平。为了研究在什么样的激励机制下可以达到社会公认的经济目标或伦理目标，需要有一套严密的理论来分析，这就是赫维兹在20多年前创立的资源分配机制理论。这个理论包括两部分，即信息理论和激励理论。它着重研究个人在自利动机驱使下，如何按照自己所处的经济环境（包括消费偏好，生产组合的可能，产品成本和初始资源，如技能、资本）和其它成员交换信息。社会在这样一个信息环境中按规定的分配规则运转，最后会导致一种资源利用的状态。如果这一状态符合于帕累托最优或某种意义上的公平，我们称之为激励相容。但由于机制设计中的问题，人们可能不愿意说真话，例如隐瞒偏好，虚报成本，以达到揩油（或曰免费搭车，或吃大锅饭）的目的，从而造成某个社会目标不能实现，或激励上的不相容。这个理论还研究更普遍的规则，例如信息利用的效率、信息传递中的误差、激励相容的条件等。由于这一理论的高度抽象性，需要用对策论、微分

拓扑等数学。田国强在这方面有很强的优势。他的博士论文解出了一个新的机制，改进了赫维兹在1979年得到的结果，并因而被授予史龙博博士论文奖。但激励机制设计理论目前国内还很少有人研究。读了他的这篇文章可以大体知道这个理论的思路、已经得到的主要结论，以及这些结论对于现实的体制改革有什么意义。

陈平的文章《新古典经济学的局限和非线性经济学的发展》充分表述了一位具有物理学训练的学者对经济理论的独特思考。文章从讨论自然科学和社会科学(如果可以称之为科学的话)在哲学上的异同出发，回顾了新古典经济学的成就和困难。1969年诺贝尔奖设立经济学奖，意味着对经济学成为一门科学的某种程度的承认。这主要是因为微观经济关系中不但对研究的对象和前提有了严密的定义和规定，而且在逻辑上建成了完整的理论结构框架。然而在宏观上这套理论一直未能解释经济波动的原因。为了弥补这一理论上的缺陷，萨尔缪森、希克斯、古德维恩等一代经济学大师为此作了不懈努力。他们开始时用线性差分方程来描述经济运行，以后又引进了非线性机制。然而统计资料的分析未能清楚地印证这些理论。1959年奥斯本对股票市场价格变化的研究中，发现股市变化遵循微粒在悬浮状态下作不规则的布朗运动的规律。这一发现动摇了传统的决定性理论的基本前提。但“混沌”现象的发现却从另一个方向对经济运行作出了解释。这个理论证明了简单的、低维数的决定论系统，只要变量间存在着非线性关系，随着时间的推移，就会出现非常复杂的非周期行为，这种不规则运动与随机运动非常相似。尤其是耗散系统中存在“奇怪吸引子”，它具有非整数维数，使得系统的演变具有更丰富的可能途径。这一套理论原是为了解释流体力学中的湍流而发展起来的，以后成功地应用于更多的物理、化学和生物现象。现在用它来说明经济现象，使得自然科学和社会科学之间更多了一条沟通的桥梁。陈平

现在的工作单位：得克萨斯大学普里高津统计力学研究所，正是在诺贝尔奖金得主普里高津领导下从事开拓统计力学应用的一个极具实力的科研单位。陈平则成为非线性经济学研究中的主力。他的主要贡献是从宏观货币指标中发现，消除（或更恰当地，利用了）长时期内趋势性变化信息后的数据，货币指标可以很好地符合决定论运动的特征。并且找到了维数为 1.5 左右的奇怪吸引子。这一结果是他在 1985—1987 年内获得的。接着 1987 年 10 月股市暴跌的现实使经济运行中非线性效应的理论更受到普遍重视。虽然这一理论尚处于初创阶段，但由于它动摇了传统理论中不少基本观点，所以具有某种程度的革命性意义。

杨小凯是我们熟悉的经济学家，他在出国深造之前就已出版过 3 本有影响的经济学专著：《经济控制论初步》、《数理经济学基础》及《经济控制理论》。他在本集中提供的一篇文章《贸易理论和增长理论的重新思考及产权经济学》，实际上是他早期分工理论的深化和严密化，也是他的博士学位论文的精华之所在。他在本文开头就突出了劳动分工对经济增长的重要性。分工的作用在斯密的《国富论》里是放在与价格机制产生的看不见的手的作用同等重要的地位上，但后来新古典经济理论的发展却把主要精力放在了均衡价格导致最优资源分配的研究上，而对分工理论很少注意。一些最主要的经济增长模型简单地把资本积累归结为增长的主要原因。这一理论上的误导对经济实践以及经济政策有着重大影响。杨小凯在本文中从介绍本世纪 20 年代的经济学家杨格的理论开始，说明了技术进步对经济的帮助，并不是由于科学家的偶然发现，而实为劳动分工的结果。一个市场体制能鼓励不断细化分工的，必能迅速将新技术用之于生产，并进一步产生对新技术的需求。这是分工通过科技促进经济发展的实质。反之，如果缺乏一个能吸收新技术的市场制度，技术和经济实为互不相干的两种活

动。我国大量成果之不能被应用，正是市场体制之不完善造成的。

分工要能取得经济效益必须有一个前提，即大规模生产能比小规模优越。然而这与一般均衡理论要求生产函数为凸集的假定相悖。在现实经济生活中有许多例证，说明存在分工时凸集的假定是有问题的。在缺乏自然资源形成的比较利益时，国际贸易仍可因分工而得到发展，这正是大规模生产所提供的利益造成的。杨小凯在经济理论上的贡献是用模型将专业化分工的讨论纳入了严格的数学模型，并证明在生产函数非凸且考虑交易费用时经济仍能在竞争中达到均衡。

本文的最后一部分讨论产权经济学的各个学派的见解。这一新近迅速成长的经济学分支要解决的根本问题与我国所面临的企业公有制下能否有有效的市场和竞争的问题有关。作者在此引用了科斯提出的理论：只要有明确的私有产权，许多有外部效应的经济活动可以通过契约安排达到最佳经济效果。因为在企业也可以作为交换对象时，私人的契约关系可以选择到最佳的资源分配和制度安排。这里还有一个重要的推论，即企业制度的合理化将节约交易费用，从而进一步促进分工。

文贯中的文章《发展经济学的新动向》介绍了近年来对农业与经济发展关系的重新认识，讨论了农民与土地的各种关系：自耕、佃地、分成、雇工，以及这些情况下农户的行为，即他们对土地的投入，包括劳动及实物和资本的投入。大量的理论研究和实证调查，证明农民会根据自身效用极大化的原则，对不同的土地关系作出反应，其结果是不同的生产效率。文章的最后部分讨论了市场不完备时（产品市场和投入品市场），农民行为受到了影响。无疑，这种影响不利于提高农业的效率。我国改革以来，土地关系发生了巨大变化，与此同时农业劳动生产率得到巨大的提高。但是这种潜力远未用完。文贯中在《科技导报》1988年4期上刊文《中国现行

土地制度的弊病及其对策》，根据他自己的研究，分析了我国土地制度缺乏效率（这导致了农产品价格猛涨）的原因。文中还积极地提出了可行的对策。

本文集中有两篇专门讨论国际贸易理论的文章。王建业写的《开放经济条件下的贸易和产业政策》是在新古典微观经济理论框架内探讨国际贸易理论的新发展。文章首先论述了自由贸易可以导致最大的国民福利，甚至在对方国家采取贸易保护政策时此结论依然成立。可是这一为全世界所公认的贸易理论，在我国却还远未深入人心。其实，自由贸易可以导致最佳经济效益的国际贸易原则同样适用于国内贸易。所以每当我们发现某种经济浪费需要纠正时，正确的办法是取消自由贸易和公平竞争的各种障碍，而不是实施限价、专卖、加税、甚至干脆禁止某种贸易，而这些恰是我们最常用的对付损失宏观经济效益的办法。

王建业接着指出，自由贸易能使国民福利极大化是有前提的。当这些前提不存在时，政策干预便可能产生好的效果。首先一个例外是一国对于某种商品具有垄断地位，此时存在着采取干预手段改善自己处境的机会。第二种情况是规模收益递增，文中还举出客运飞机市场为例来作说明，其实这种情况与垄断有联系。第三是从动态考虑有必要对发展中国家处于发展初期的婴儿工业进行保护，他们的生产成本会沿着学习曲线下降，只有成本下降之后才能实施自由贸易政策。第四是发展高技术产业所发生的有益的外部效应，此时偏离自由贸易能有外部得益。还有一种情况是原来的市场（无论是国内或国际）就不是一个均衡市场，施加政策干预也可能改善经济效果。

接下来作者介绍了发达国家创新技术，然后向发展中国家扩散，这一过程引起国际贸易的特点；讨论了穷国富国国内收入分配对国际贸易的影响。在前面讨论的基础上，王建业介绍了他自己

以及其他学者对发展中国家贸易政策的建议,特别是关于开放,引进先进技术及外资的政策建议。文章的第五节讨论了政府无能或腐败对国际贸易的影响。作者最后对干预自由贸易的政策发出了警告。有些干预似乎是合理的,但由于信息收集的困难,干预的分寸很难掌握得当,而且从局部均衡看是合理的干预,放在一般均衡里来看未必合理。何况任何干预都可能招致报复。王建业的这篇文章条理清楚,层次分明,把复杂的国际贸易问题交待得十分透彻明了。

本文集中另一篇讨论国际贸易的文章,是本集主编汤敏写的《南北贸易理论的一些新发展》。文章首先介绍了在均衡模型范围内,用以解释南北贸易中发展中国家贸易条件恶化的种种理论。例如发达国家工会组织争取工人的高工资使产品成本上升,并通过工业品的出口转嫁给发展中国家;资本和劳动的流动在这两类国家之间不对称(劳动不能自由流入发达国家),使发展中国家受损;加工工业与初级产品业的规模经济特性不同,使发达国家不断从增加出口扩大生产规模中受益,而发展中国家则不能;富国的高消费示范作用使穷国更多地依赖于富国的高档消费品的出口等等。

但是亚洲四小龙依靠外贸而获得经济起飞的事实,吸引经济学家将注意力转向了出口扩张与经济增长的研究。文中介绍了几位经济学家对60和70年代发展中国家出口增长与经济增长关系的实证研究。他们的结论包括出口导向比之进口替代更有利于经济增长;一国要靠出口带动经济起飞只有当内部经济达到某一组织水平才有可能等。但也有一些经济家用不同的归类方法,得出出口与经济增长无关的结论。

汤敏专门辟出一节讨论出口导向的经济可能遇到的问题。例如品种单一的大量出口(如石油)容易引起一枝独秀百业凋敝的畸形发展;出口大量增加而农业发展跟不上时,会使食品价格上升而



实际生活水平降低。特别令人感兴趣的是通过一些假设的模型，论证了在一定条件下增加出口反而导致贫困是可能的。这些研究说明了国际贸易理论的探索至今仍是经济学的—个热门领域。

文章的最后一节讨论了亚太地区新兴工业国(或亚洲四小龙)的经验是什么，以及他们的经验能否推广的问题。虽然他们的经济都有很大的出口比例，但在政府干预和市场发达的程度，产业政策中进口替代的重要性，国营企业的比重等方面彼此差别很大。有一派经济学家为认推广他们的经验是可能的，其中—条主要理论依据是比较利益的阶段理论，即先行的工业化国家不断将产业推向新技术的较高水平，留下的空档为从后面跟上的国家所填补。然而另—些经济学家则持悲观态度，因为先行的工业化国家并不会自愿退出原先占领的市场份额，而且世界市场的总容量是有限的，所以步他们的后尘是困难的。

张欣的文章《对策论》，讨论人在经济活动中如何在特定的环境下对别人的行为作出反应。我国常说的一句话“上有政策，下有对策”，意思是国家的政策由于下面的企业和个人拿出了相应的对策，使原定的政策目标不能达到。或者说，政策没有考虑到对象可能作出的反应。对策论就是研究人在可供选择的方案中(称为行动空间)按照事先给定的利害关系(支付评价)作出决策的规律。文中提到—个例子“囚犯的难题”，说的是两名同案犯在彼此隔绝信息的情况下，由于怕对方招供自己不招而受到严厉惩罚，而揭发别人又能立功受奖，最后的结果将是两人都分别招供。这构成决策的—个均衡点。我国类似的—个现象是企业 and 单位滥发奖金和实物，其实这也是一—个均衡策略，所不同的这不是—个二人游戏，而是数目极大的人参与的游戏。因此在前—例中如果游戏反复进行，参与的人通过学习过程而会改变决策(彼此都不招供)，而在后—例中就没有这种可能。这说明了虽然滥发奖金最终于大家都不利，