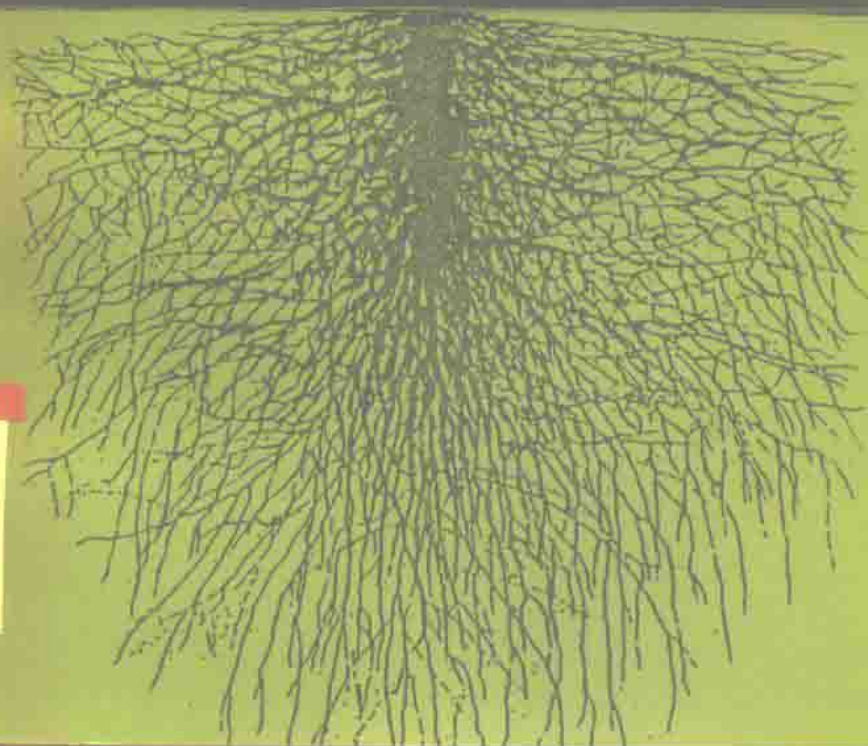




經濟科學文庫
JINGJIKEXUEWENKU

宏觀非均衡的微觀基礎

楊瑞龍 著



經濟科學文庫
JINGJIKEXUEWENKU

宏觀非均衡的微觀基礎

楊瑞龍 著

中國人民大學出版社

(京)新登字 156 号

经济科学文库

宏观非均衡的微观基础

杨瑞龙 著

出版者:中国人民大学出版社

发行者:中国人民大学出版社

(北京海淀路 39 号 邮码 100872)

印刷者:北京市丰台区丰华印刷厂

经销者:新华书店总店北京发行所

开 本:850×1168 毫米 32 开

字 数:224 000

印 张:11.375 插页 5

版 次:1994 年 2 月第 1 版

印 次:1994 年 2 月第 1 次印刷

册 数:1—2 500

书 号:ISBN7-300-D1712-6/F·463

定 价:14.80 元

《经济学文库》

编委会

主编

黄 达

副主编

徐安琳 樊 纲 魏 杰

编委

(按姓氏笔画为序)

马庆泉	马建堂	贝多广
王松奇	王逸舟	卢中原
叶 坦	刘 伟	李 扬
李拉亚	李晓西	陈 莹
陈东琪	杨瑞龙	张宇燕
林 岗	金 碚	钟朋荣
郭树清	徐安琳	高海燕
常 青	梁 晶	黄 达
黄小祥	黄泰岩	蔡 昉
蔡重直	樊 纲	魏 杰

经济科学文库·总序

马克思主义历史唯物主义认为,经济活动是人类一切活动中最基本的活动;当今世界上有人把经济学称为“社会科学皇冠上的明珠”;我们正在进行着经济改革,有关经济改革和发展的一切,总是成为人们最关心的话题;经济改革的成败,关系着祖国的前途、民族的命运,经济学家们在这一伟大的历史进程中担负着无法推卸的重要责任,必须用自己特有的方式去为这一事业作出自己的贡献。我们这部《经济科学文库》,就是对中国经济学家思维成果的记录,是为我国经济科学的建设和发展服务的。

经济改革和经济发展的伟大事业,不仅要求经济实践家们提出一系列直接针对当前现实问题的对策,也要求经济科学工作者提出一整套于理解现实问题有补、对解决现实问题有益的经济理论,作为战略研究和政策分析的基础;同时还要对各种历史和现实的问题进行细致的实证分析,用丰富、翔实的经验资料,对各种理论的科学性和各种政策的有效性作出检验。过去

10年中我国的经济科学研究有了蓬勃的发展,进入90年代,中国的经济学家们正在把更多的注意力放到经济理论和实证研究上来。这或许正是我们的国家、我们的改革事业和我们的经济科学将有更大发展的一个前提。《经济科学文库》作为一块新的科学研究园地,愿经济学家们的心血在此浇灌出更多、更美的鲜花。

《经济科学文库》将以马克思主义为指导原则,提倡追求科学、坚持真理、求实创新的学风,鼓励严肃认真的研究、扎扎实实的工作,相比之下,我们将更加重视研究成果的长久价值,希望今后人们能够看到这套丛书中的许多内容,经受了实践的长期检验而成为人类科学知识积累中的一个组成部分。既然是科学探索,就难免会出现这样那样的错误。但在科学发展的道路上,只要是严肃的探索,即使事后被证明是错误的,也会因为向人们表现了“此路不通”而为其他人通向真理扫清了障碍。正因如此,我们将在马克思主义的指导下,开展积极而严肃的学术批判和学术争鸣。我们将积极扶植学术新秀,使《经济科学文库》成为中青年经济科学工作者的一块新的出版园地,我们还将尝试一些评价学术成果的新方式,加强学者与出版界的合作,在制度上保证丛书的质量。

希望作者和读者与我们一起,关心、爱护这套丛书,共同办好这部文库!

《经济科学文库》编委会

1991年4月

序

摆在读者面前的这部专著《宏观非均衡的微观基础》，是杨瑞龙同志在其博士学位论文的基础上修改而成的。他的博士论文曾获得由我国著名经济学家所组成的答辩委员会的一致好评。在他的新作问世之际，我作为他的导师，与作者一同分享着收获的喜悦。

在博士学位论文选题过程中，我对作者提出了如下几点要求：一是要选择现实性较强而又具有理论意义的问题进行研究；二是要选题新颖，力争开辟新的研究领域；三是要有较高的起点和理论层次，力争使研究成果达到较高的水平；四是要选择有利于发挥自身优势的问题进行研究。在充分酝酿的基础上，他把论文题目定为《宏观非均衡的微观基础》，运用非瓦尔拉斯均衡理论来研究非均衡的中国经济。研究提纲拟出后，我邀请了几位著名教授，以开题报告会的形式，审查了他的选题和研究计划。专家们提出了许多宝贵的建议。在此基础上，作者制定了详细的写作计划，并在出国进修之前完成了论文初稿。在赴澳大利亚昆士

兰大学访问期间,他继续进行上述课题的研究,阅读了大量非均衡理论方面的文献,用英文撰写了两篇论文,形成了博士论文的修改计划。回国进行论文答辩后,又集中精力对论文作了重大修改,使论文质量有了明显的提高。

综观杨瑞龙同志的这部新作,具有以下特色:第一,作者在占有大量非均衡理论的中外文献、深入掌握和正确评价前人研究成果的基础上,进入了国内这一研究领域的前沿;第二,该书把非瓦尔拉斯均衡理论作为宏观经济学的微观基础,并把全书纳入非瓦尔拉斯均衡分析体系,研究角度和研究方法比较新,结构比较合理;第三,该书不仅在研究方法上使宏观分析与微观分析相协调,而且还从微观角度深入分析了宏观非均衡的存在条件,因而从理论与实际两个方面使宏观与微观有机地统一起来;第四,该书把分析的重点放在向市场经济过渡的体制转轨时期的宏观非均衡及其微观基础上,这既有理论价值,又有实践意义;第五,作者在书中提出了不少值得重视的新观点和新思路,例如,作者对我国市场非均衡条件下的价格调整和数量调整的分析,对非均衡所作的规范分析,以及对双层股份制模式的构想等,都是颇有新意的。

当然,该书也有一些不足之处。我希望作者以此书为新起点,继续刻苦钻研,不懈地探索,为经济学的繁荣作出更大的贡献。

胡乃武

1992年10月10日于中国人民大学

目录

导论(1)	
§ 0.1	宏观经济学与微观经济学相互割裂的现状(1)
§ 0.2	非均衡分析与宏观经济学的微观基础(4)
§ 0.3	本书的理论贡献与结构安排(7)
1 篇 非均衡理论与宏观经济学的微观基础(11)	
1 章 远离现实的假说:瓦尔拉斯一般均衡论(13)	
§ 1.1	理想境界:瓦尔拉斯均衡(13)
§ 1.2	一种具有严密逻辑的虚构(19)
§ 1.3	建立在瓦尔拉斯均衡论之上的兰格模式及其评价 (24)
§ 1.4	瓦尔拉斯一般均衡论的理论价值(28)

2 章 均衡概念的拓展:非瓦尔拉斯均衡理论(31)	
§ 2.1	市场非出清:原因探究(31)
§ 2.2	一种新的理论假说:非瓦尔拉斯均衡理论(40)
§ 2.3	瓦尔拉斯均衡与非瓦尔拉斯均衡的比较(45)
§ 2.4	一个新的理论热点(49)
3 章 非均衡理论:宏观经济学的微观经济学基础(54)	
§ 3.1	总需求的微观基础(54)
§ 3.2	总供给的微观基础(60)
§ 3.3	宏观经济学与微观经济学的脱节(66)
§ 3.4	非均衡分析:沟通宏观分析与微观分析的桥梁(72)
2 篇 宏观非均衡的微观基础:多视角考察(77)	
4 章 市场体制下的宏观非均衡及其微观基础(79)	
§ 4.1	数量限额下的家庭经济行为(79)
§ 4.2	数量限额下的企业经济行为(84)
§ 4.3	宏观非瓦尔拉斯均衡类型考察(89)
§ 4.4	理论模型的现实价值与宏观非均衡类型区分的政策含义(98)

5 章 传统计划体制下的宏观非均衡及其微观基础(104)	
§ 5.1	短缺经济运行的制度框架:理论准备(104)
§ 5.2	需求膨胀机理:投资需求与消费需求的决定(110)
§ 5.3	传统计划体制下的宏观非均衡模型(116)
§ 5.4	两种思路:科尔内模型与波兹模型的比较(124)
6 章 向市场经济过渡时期的宏观非均衡及其微观基础(133)	
§ 6.1	体制演变:放权让利改革战略的选择(133)
§ 6.2	总需求膨胀与总供给约束的微观机理:制度分析(137)
§ 6.3	宏观非均衡:供求缺口扩张机制(150)
§ 6.4	通货膨胀的形成机制:结构分析(154)
3 篇 向市场经济过渡时期的市场运行机制:实证分析(165)	
7 章 市场非均衡下的经济主体行为机制(167)	
§ 7.1	市场非均衡下的家庭经济行为(167)
§ 7.2	市场非均衡下的企业经济行为(176)
§ 7.3	市场非均衡下的地方政府经济行为(187)

8 章 市场非均衡下的价格调整及其宏观效应(193)	
§ 8.1	数量限额下的价格调整:一般理论考察(193)
§ 8.2	价格控制的微观效应与宏观效应(199)
§ 8.3	市场非均衡下的计划价格调整及其宏观效应(208)
§ 8.4	双轨市场中的价格调整及其宏观效应(217)
§ 8.5	体制转轨时期市场非均衡的溢出效应和乘数效应(228)
9 章 市场非均衡下的数量调整及其宏观效应(235)	
§ 9.1	除不清市场与数量配额模型(235)
§ 9.2	数量调整与价格调整的速度比较(241)
§ 9.3	计划体制下数量调整与市场体制下数量调整的差异(247)
§ 9.4	向市场经济演进过程中的数量调整:供给分析(255)
§ 9.5	向市场经济演进过程中的数量调整:需求分析(261)
4 篇 均衡取向:非均衡条件下的政策调整和体制改革(267)	
10 章 探求市场非均衡的体制原因:规范分析(269)	

§ 10.1	价值判断:非瓦尔拉斯均衡态的规范分析(269)
§ 10.2	内生性市场非均衡与外生性市场非均衡(273)
§ 10.3	起点与归宿:由非均衡走向均衡(277)
§ 10.4	达到均衡的途径:政策选择与体制改革(279)
11 章 市场非均衡下的宏观经济政策选择(282)	
§ 11.1	宏观经济调控的微观基础(282)
§ 11.2	双重竞争规则的冲突:宏观调控能力弱化的微观原因(286)
§ 11.3	既定体制条件下的宏观经济政策效应分析(291)
§ 11.4	既定体制条件下的宏观经济政策选择(294)
12 章 向市场经济体制过渡:市场机制的完善(298)	
§ 12.1	价格改革是完善市场机制的前提条件(298)
§ 12.2	市场主体的塑造是完善市场机制的关键环节(303)
§ 12.3	市场要素系统的完善与竞争性市场的构造(306)
§ 12.4	市场取向改革的深化与市场体系的完善(310)
13 章 产权制度变革与微观基础的再造(314)	
§ 13.1	两权分离下企业自负盈亏的条件(314)
§ 13.2	承包制难以使企业走上完全自负盈亏之路(317)

§ 13.3	产权明晰化:深化企业改革的方向(322)
§ 13.4	我国股份制模式的构造(325)
§ 13.5	由承包制向双层股份制模式过渡(333)
参考文献(339)	
后记(349)	

均衡与非均衡是经济学中出现频率很高的一对范畴。不少经济学家深信,只要价格具有充分的弹性,市场将自动达到均衡。与此信仰相联系的一般均衡模型被构筑得越来越精致、完美。然而,现实偏偏与这些经济学家开了一个不大不小的玩笑:非均衡是经济运行的一种常态,即在既定价格下,市场并未被出清。非均衡学派的诞生,使均衡学派面临严重的挑战。现实的中国经济也是非均衡经济,因此,非均衡理论对中国的经济学家产生着越来越大的吸引力。

§ 0.1 宏观经济学与微观经济学 相互割裂的现状

宏观经济学考察的是国民经济作为整体的功能,研究生产

资源总量的决定；微观经济学考察的是既定资源总量的配置。它们是整体与个别、总量与个量的关系，并且宏观经济理论体系的建立总是以一定的微观经济行为分析为基础的。但是，如果翻开西方近现代经济学的发展史，便会发现宏观经济学与微观经济学长久以来处于割裂状态，它表现为古典学派与凯恩斯学派在分析方法上的不协调性。

古典学派考察的是当资源达到充分利用时的最优配置问题，是一种典型的微观经济学。古典学派的理论基础是瓦尔拉斯(Walras)的一般均衡论与马歇尔(Marshall)的局部均衡论。在瓦尔拉斯的一般均衡体系中，存在着一套涉及所有商品和劳务(包括劳动和资本)的相对价格，这套相对价格将同时使所有市场达到供求均衡，即当成交价格为均衡价格时，市场上买方按照该价格愿意买进的数量恰好等于卖方按照该价格愿意卖出的数量，因而不可能存在超额需求或超额供给。瓦尔拉斯均衡体系建立在以下的假定条件之上：存在一个不断调整价格的“拍卖商”，价格无代价地传递信息，行为人只根据价格信号调整供给量与需求量，均衡价格为成交价格，行为人对未来拥有完全的信息等。

自凯恩斯(Keynes)的名著《就业、利息和货币通论》问世以后，凯恩斯主义就成为宏观经济学的代名词。凯恩斯与古典学派决裂，以总产量及资源总利用量的决定为考察对象，引入了数量变量，完成了宏观经济学的体系构造，以解释自1929年的世界性经济危机以来大量存在的资源闲置与大量失业的经济现象。

凯恩斯指出,有效需求不足导致非自愿失业的存在。这种宏观失业均衡模型本身就意味着凯恩斯经济学是一种非均衡经济学。从非均衡角度重新解释凯恩斯学说的代表人物首推莱荣霍夫德(Leijonhufvud),他在《凯恩斯主义经济学和凯恩斯经济学》一书中指出:在凯恩斯模型中,由于行为人面临的是一个缺乏完全信息的世界,因而数量(产量、就业量等)调整速度快于价格调整速度;包括工资在内的所有价格仅仅缓慢地变动,并非像古典学派假定的那样,价格具有充分弹性;失业的基本原因是“相对价格不合适”:利息率过高,长期债券价格过低。^①也就是说,非均衡分析已成为现代宏观经济学的一种公认的特色。

于是,可以看到这样一种有趣的现象:在微观经济学领域,瓦尔拉斯均衡理论占据统治地位;在宏观经济学领域,流行的是凯恩斯宏观失业均衡理论。微观上的均衡分析与宏观上的非均衡分析使得宏观经济学与微观经济学实际上处于割裂状态。尽管新古典综合派与新剑桥学派都试图重建凯恩斯宏观非均衡理论的微观基础,但收效甚微。

在社会主义经济理论发展史中,宏观分析与微观分析相互脱节的现象也是十分明显的。在以国民经济的总体为考察对象时,一般总承认存在着过度需求,短缺与滞存同时并存。但在进行微观分析时又摆脱不了瓦尔拉斯一般均衡论的影响,即以瓦

^① 参见 A. Leijonhufvud, *On Keynesian Economics and the Economics of Keynes*. Oxford University Press, London and New York, 1968.