

DANGDAIJINGJIXUEXILIE
CONGSHU ● 当代经济学系列丛书



当代经济学新知文丛

● 樊 纲 著
● 上海三联书店出版

市场机制与经济效率

DANGDAIJINGJIXUEXILIE CONGSHU

市场机制与经济效率

• 樊 纲 著

• 上海三联书店出版



当代经济学新知文丛

(沪)新登字 117 号

责任编辑 陈 昕

封面设计 宋珍妮

市场机制与经济效率

樊 纲 著

生活·读书·新知

三联书店上海分店出版

上海绍兴路 5 号

新华书店上海发行所发行

常熟市印刷六厂印刷

1992 年 12 月第 1 版

1992 年 12 月第 1 次印刷

开本: 850 × 1163 1/32

印张: 7 插页: 2 字数: 150 000

印数: 1—2000

ISBN 7-5426-0606-9/F·140

定价: 8.90 元

出版前言

为了全面地、系统地反映当代经济学的全貌及其进程，总结与挖掘当代经济学已有的和潜在的成果，展示当代经济学新的发展方向，我社决定出版“当代经济学系列丛书”。

“当代经济学系列丛书”是大型的、高层次的、综合性的经济学术理论丛书。它包括四个子系列：(1)当代经济学文库；(2)当代经济学译库；(3)当代经济学教学参考书系；(4)当代经济学新知文丛。该丛书在学科领域方面，不仅着眼于各传统经济学科的新成果，更注重经济前沿学科、边缘学科和综合学科的新成就；在选题的采择上，广泛联系海内外学者，努力开掘学术功力深厚、思想新颖独到、作品水平拔尖的“高、新、尖”著作。“文库”力求达到中国经济学界当前的最高水平；“译库”翻译当代经济学的名人名著；“教学参考书系”主要出版国外著名高等院校80年代后期90年代初期的通用教材、“新知文丛”则运用通俗易懂的语言，

介绍国际上当代经济学的最新发展。

本丛书致力于推动中国经济学的现代化和国际标准化，力图在一个不太长的时期内，从研究范围、研究内容、研究方法、分析技术等方面逐步完成中国经济学从传统向现代的转轨。我们渴望经济学家们支持我们的追求，向这套丛书提供高质量的标准经济学著作，进而为提高中国经济学的水平，使之立足于世界经济学之林而共同努力。

我们和经济学家一起瞻望着中国经济学的未来。

上海三联书店

前 言

1

随着改革开放的深入进行,市场的作用在我国日益加大,市场机制在整个国民经济中正逐步成为调节资源配置的主要经济运行机制。这就要求我们对市场机制本身有更加全面、更加深入的认识。过去,在不存在市场机制或市场发育还很不健全的情况下,我们所面临的主要任务是如何发展市场经济,充分发挥其作用。那时,我们往往看到的是或主要强调的是它的积极的一面。现在,当它逐步发育起来的时候,我们就要充分注意到它的各方面的特点,既看到它促进经济效率提高的不可缺少的积极作用,也要看到它可能引起的各种问题,看到它在改进经济效率方面的各种局限性。充分认识到这些局限性,并不意味着不要进一步充分发展市场机制,而是为了使我们对于可能出现的各种问题,能够有一个更为充分的思想准备,不至于一见到这些问题就大惊小怪,甚至因噎废食,走回头路。天下的事物总是有两面性的,十全十美的经济运行机制是不存在的,至少迄今为止还是不存在的;

因此，我们只能在一定的现实条件下，从各种并不十全十美的经济机制中选择较好的或最好的，并在实行这种机制的时候，充分认识它所带来的各种问题，以寻找相应的对策。

在现代经济中，市场经济已获得了相当充分的发展，相应地，关于市场经济的理论，也已获得了相当充分的发展。现代经济学理论中的很大一部分内容，甚至可以说是主要的内容，就是对市场经济的运行方式、运行结果以及它所产生的各方面的问题进行分析。这些分析包括相辅相成的两个方面：一是在“市场完全性”的假定下（假定市场是“完全竞争”的，信息是充分的，不存在交易成本，等等），说明市场机制能够解决哪些问题，怎样促进经济效率的提高或“社会福利”的提高；另一方面，则是根据“不完全的”经济现实，说明市场经济不能解决什么问题，市场经济在效率方面有哪些局限，什么时候会发生“市场失效”，可以采取什么方法进行补救，这些补救办法本身又有什么局限性，会引起什么问题。

一般的初级经济学教科书，介绍了市场经济的基本运行机制，说明了在市场经济条件下消费者和生产者的基本行为方式，描述了局部市场上的价格决定和资源配置过程，但却没有阐明以下几方面的问题：

1. 整个市场体系中各局部市场之间是如何相互联系、相互协调的，“看不见的手”是如何在由众多市场构成的、不仅包括无数产品市场而且包括各种要素市场和货币信贷市场在内的整个市场体系上，协调各种经济活动，实现市场的“一般均衡”和资源的最优配置。

2. 所谓的资源“最优配置”，究竟指的是什么？所谓的“经济效率”，其确切涵义又是什么，它是否包含着“价值判

断”，包含着怎样的价值判断？“最优配置”与所谓的“社会福利最大化”之间是否可以划等号，只有在怎样的前提假定下它们才可以划等号？

3. 现实的经济，究竟在哪些方面有别于理论上所描述的那种能够实现“一般均衡”、“最优配置”的完全竞争的市场经济模型，究竟是哪些因素决定了现实经济的非完全性，并因而导致了各种各样的“市场失效”，使我们在现实中往往只能见到各种各样的“非均衡”或“非最优配置”。

4. 是哪些因素决定了在现实中会出现“政府干预”，政府干预本身又有什么局限性？在什么样的条件下政府干预会取得较好的结果，在什么条件下又会出现“政府失败”，反而使经济更加远离“最优配置”；应该如何理解“公共选择”的过程，特别是如何理解任何一种公共选择过程中所必然包含的各种利益冲突，从而正确地分析“政府”这个实现公共选择的社会机构在各种条件下所采取的各种政策？

这些内容，事实上正是近几十年来处于经济学“理论前沿”的各种问题，是各派经济学家都致力回答的问题。通过几十年的努力，现在，对这些问题的研究已取得了很多的成果，并形成了一些为大家一致同意的、“公认”的基本理论。这些公认的东西，不仅已成为各派经济学家在讨论或争论时所依据的共同基础，而且日益成为任何一个经济学家所必须掌握的“必备知识”，成为现代经济分析所必备的理论基础（其中的许多内容，已被写进了“中级”经济学教科书，便证明了这一点）。

本书的目的，就是对上面所说的这些一般初级经济学教科书所不予讨论、未予介绍的有关市场、政府与经济效率的

经济理论作一简明的但较为系统的讨论。在今天，掌握这些理论，不仅对于真正理解各种经济学前沿问题的争论是必须的（比如，不理解“帕累托最优”这个已被广泛使用的理论概念，就不可能理解当今经济学界在前沿上所讨论的几乎所有理论问题），而且对于理解和分析我国经济已经发生、正在发生和即将发生的各种经济现象和经济问题，也是必要的（比如，不把握公共选择理论的一些内容，在理解和分析现实中存在的各种利益冲突和现实中的政府决策过程的时候，就往往会得出错误的结论）。当然，本书的目的，不是将有关理论的全部内容和分析方法作详细的介绍，而是力求在尽量小的篇幅内，将各方面理论的主要内容作一简要的阐述，使读者看到它们之间的相互联系和它们在整个经济学中所处的地位和所起的作用，力求使读者对这些内容的基本思想、分析方法及其相互联系，有一系统的理解。本书的基本结构是：

——首先阐述市场一般均衡理论，说明各个市场之间的相互关系和整个市场体系的运行方式（第一篇）；

——进而研究市场均衡的所谓“社会福利含义”，通过对福利经济学的讨论，说明市场均衡与社会福利最大化的关系，以及对经济运行结果进行效率判断的各种标准（第二篇）；

——说明引致“市场失效”的各种原因，如信息不完全或信息不对称，存在交易成本，存在外部经济效应，等等（第三篇）；

——最后，分析引起“政府失败”的种种原因以及一般的公共选择过程中所发生的各种问题（第四篇）。

2

本书所涉及的内容,基本上是初级教科书中所不包括的。之所以如此,除了理论内容本身较为复杂因而不适合初级教科书之外,一个重要的原因就在于有关的理论涉及到较为复杂的数量关系,因而在分析和表述时,往往不可避免地要使用一些数理分析的方法,既包括初级教科书中已经开始使用的图形描述和简单的解析方法,也包括使用微分方程、高等代数、集合论等等较为高深的数学分析方法。从一定意义上说,不掌握一定的数理分析方法,就很难掌握今天的经济学中的许多理论。

数学方法不是经济思想,但一定的数学方法的确有助于经济思想的表达、整理与发展。第一,它有助于经济思想更加精确、准确、严格,特别是在有关经济变量关系的分析研究当中,就更是这样。第二,它有助于提高理论的概括性,使复杂的经济理论,得到更加简明的表达,从而有助于思想的深化。比如,利用集合论的方法,可以将一系列的方程、无数的变量,浓缩为一个简短的公式,既容易在思维中加以清晰地把握,又便于在论著中加以简捷地表达。第三,数学方法特别是几何图形分析方法,更有利于使复杂的数量关系取得一种直观的表述形式,有利于作者自己展开分析,也有利于读者加以理解和把握。不容否认,经济学界存在过、今天仍然存在着“唯数理论”的倾向,好像什么东西若还没有找到一种精确的数学表达方法,未经过数理方法的论证,就算不上经济理论;许多人把大部分精力花费在数理方法本身的

研究和运用上去，似乎只有这方面的进展才是经济理论的进展，才是“高深的学问”，而忽视经济思想本身的发展。其实，没有思想，只有数理方法，并不能使经济理论取得真正的进步。经济学家对经济理论的发展作出贡献的标志，主要在于他们提供了新的思想，而不在于他们提供了新的数学方法。不过，在充分注意到这一点的同时，我们也不能忽视对数学方法的掌握和运用，否则，我们就很难跟上经济学发展的步伐，很难在前人基础上作出我们的新贡献。

本书中我们为了介绍和分析与市场、政府和经济效率有关的一些现代经济理论，也使用了一些数理方法，主要是那些已成为在表述这些理论内容时通常必须使用的数理方法。不过，考虑到许多读者可能对数理方法，特别是较深的数理方法不够熟悉，书中，第一，尽量将数理方法使用较多、较为复杂的模型，转化为对数理方法要求不高的较为简单的模型，比如将多变量模型减化为单变量模型，用较简单的方法，说明理论的基本内容，在可不使用数理方法的地方，主要采用文字叙述。第二，对理论内容本身，都作了文字叙述，不熟悉数理方法的读者，将数理分析部分略去不读，也可把握理论的基本思想。

本书所分析各种经济理论，通常是不包含在一般的初级经济学教科书当中的（如国内迄今翻译和编写的各种西方经济学教科书）。但是，这些理论本身又是以“初级”经济学为基础的。为了使读者便于及时查阅到有关的基本理论，本书提供了一个“附录”：“经济学基本概念”，将有关内容作了提纲挈领式的阐述，以供读者在遇到有关概念时加以查阅和参考。

目 录

前 言

第 1 篇 一般均衡理论

1	导论：一般均衡理论的基本概念	3
1.1	个别市场与市场体系	3
1.2	局部均衡与一般均衡	4
1.3	交换均衡与生产均衡	5
1.4	外定条件与市场变量	6
1.5	理论史简述	9
2	交换均衡	10
2.1	行为主体与商品	10
2.2	理论模型：埃奇渥斯方盒	13
2.3	效用最大化与交换均衡	14
2.4	瓦尔拉斯定律	17
3	生产均衡	20
3.1	生产技术与“生产可能性集合”	20
3.2	厂商行为	22
3.3	消费者行为：劳动供给	23

3.4	利润分配	25
3.5	生产一般均衡	26
3.6	一般均衡	30
4	均衡点的变化与均衡的实现过程	39
4.1	外定条件的变化与均衡点的变化	39
4.2	一般均衡的实现过程	42
4.3	小结：一般均衡的现实性与非现实性	48

第2篇 市场均衡与社会福利

5	福利经济学的基本内容	53
5.1	基本问题	53
5.2	基数效用论的福利经济学	54
5.3	帕累托原则	56
5.4	补偿原则	57
5.5	伯格森——萨缪尔逊福利函数	52
5.6	“既定的社会分配方案”	60
5.7	阿罗的“不可能性定理”	62
5.8	“社会计划者”	65
6	经济效率与帕累托最优	67
6.1	经济效率的概念	67
6.2	帕累托效率	69
6.3	经济效率概念中的价值判断	70
6.4	帕累托条件之一：消费品的最优配置	72

6.5	帕累托条件之二：生产要素的最优配置	74
6.6	帕累托条件之三：生产与消费的最优关系	76
6.7	几何图形的综合分析	76
7	帕累托最优与市场均衡	80
7.1	福利经济学第一基本定理：市场均衡与帕累托最优	81
7.2	福利经济学第二定理：禀赋分配与帕累托最优	83

第3篇 经济信息、交易成本与外部效应

8	价格信息搜寻与市场均衡的结构	91
8.1	引言：信息的不完全性	91
8.2	价格分布	92
8.3	搜寻成本	93
8.4	市场结构与单一价格均衡的基本性质	95
8.5	单一价格均衡的几种情况	97
8.6	双重价格均衡	99
9	信息不对称与信息显示	101
9.1	产品质量问题	101
9.2	风险概率	102
9.3	信息不对称问题	103
9.4	信息不对称时的均衡价格	104
9.5	逆选择原理	107

9.6	包含在价格中的信息	108
9.7	搜寻质量信号的人数	110
9.8	信号的自我显示	111
9.9	信号显示与资源配置	115
9.10	道德公害	116
10	交易成本	118
10.1	损人利己或“机会主义”行为	119
10.2	机会主义行为与交易成本	121
10.3	“交易成本”与“信息成本”	123
10.4	交易成本与产权	126
10.5	交易成本与生产成本	129
10.6	交易成本与经济体制的选择与变迁	130
11	外部经济效应	133
11.1	外部经济效应的概念	133
11.2	外部效应引起的无效率配置	136
11.3	效率改进的方法	139

第4篇 公共选择与政府管制

12	公共商品	149
12.1	一种特殊的外部效应	149
12.2	私用商品与公共商品	150
12.3	理论参照系：社会福利最大化	151
12.4	“白搭车”问题	155

12.5	政府的职能与“说实话问题”	156
12.6	公共选择与政府决策	159
13	公共选择理论	161
13.1	公共选择问题	161
13.2	如何定义“公共利益”?	162
13.3	公共选择的方式和面临的问题	164
13.4	“多数票”决策方式中存在的问题	165
13.5	“代议制”的问题	167
13.6	官僚机构的问题	169
14	政府管制	172
14.1	政府管制的特点与范围	173
14.2	关于政府行为目标的争论	174
14.3	限制垄断	175
14.4	自然垄断	177
14.5	实践中的问题	179
14.6	符合特殊利益的管制	181
附录	微观经济学基本概念	186

第 1 篇

一般均衡理论