

27.2765
F.18



西方文化叢書
高宣揚◎主編

30



市場機制 與經濟效率

樊綱◎著

25



西方文化叢書
高宣揚◎主編

市場機制與 經濟效率

樊綱◎著

30

三聯書店(香港)有限公司

西方文化叢書

策劃 潘耀明

執行編輯 唐一國

主編 高宣揚

副主編 黃鳳祝

編輯顧問 梁漱溟 洪謙 勞思光 劉述先

韋政通 葉啟政

責任編輯 虞璞

裝幀設計 陳栩椿

版面設計 陳正益

書名 市場機制與經濟效率(西方文化叢書⑩)

著者 樊綱

出版發行 三聯書店(香港)有限公司

香港域多利皇后街九號

JOINT PUBLISHING (H.K.) CO., LTD.

9 Queen Victoria Street, Hong Kong

印刷 優文印刷廠

臺北縣土城鄉永豐路 195 巷 29 號

版次 1993 年 8 月香港第一版第一次印刷

規格 大 32 開(130×209 mm) 192 面

國際書號 ISBN 962・04・1093・9

© 1993 Joint Publishing (H.K.) Co., Ltd.

Published & Printed in Hong Kong

作者◎簡介 樊

綱

1953年生於北京，1982年畢業於河北大學經濟系，獲經濟學學士學位，同年考入中國社會科學院研究生院經濟系，主攻方向為當代西方經濟學，1988年畢業，先後獲經濟學碩士、博士學位。1985—1987年間曾赴美國國民經濟研究局及哈佛大學訪問進修。現為中國社會科學院經濟研究所研究員。出版了《公有制宏觀經濟理論大綱》、《現代三大經濟理論體系的比較與綜合》等專著，在經濟學比較研究和社會主義理論經濟學研究方面頗有建樹，受到國際經濟學界的關注和好評。

總 序

作為整個世界文明的一個重要組成部分，西方文化是人類面對自然和歷史的挑戰而自我確立、並不斷鞏固其優越地位的經驗總結。梁漱溟先生在其《人心與人生》一書中，對世界各種文化進行比較研究時指出：“我們不能不承認人類現代文明實從歐美發端後乃擴展到全世界的……。”

近百年來，特別是自嚴復和梁啟超以來，先進的中國學者不斷地試圖在保存和發揚中華文化優秀傳統的基礎上，將西方文化之精華逐步地介紹到中國來，以期加速中國新文化之建設，推動整個社會現代化之進程。魯迅先生早就洞察到中國民衆之愚昧對於社會改造所起的消極作用。因此，他在痛斥時弊的同時，也時時不忘大聲疾呼引進西方先進文化之必要。

《西方文化叢書》在學識淵博的老一輩學者，特別是近半個多世紀以來一直致力於中西文化比較研究的梁漱溟先生的關懷和指導下，以系統論述西方文化界哲學、文學、史學、語言學、人類學、社會學、經濟學、法學、政治學、心理學、精神分析學、美學等各個學術領域的重要理論成果為宗旨，力求通過深入淺出的文字，來介紹西方各國各個歷史時期，特別是當代有影響的思想家、理論家、文學

藝術家的作品及流行的社會思潮，內容簡明扼要，豐富多彩，是一套具學術價值的普及性讀物。

本叢書的作者以海內外學有所成、富於創見的中年學者為主，包括中國大陸、香港、台灣以及移居或留學歐美的專家們，他們將以多樣不拘的選題及流暢活潑的文筆，從各個方面，盡可能準確地介紹西方文化之精華。我們希望，在海內外廣大作者和讀者的支持下，這套不限卷數分期分批出版的獨立專著，終將從整體上構成一部有關西方文化的百科全書式的知識文庫，為社會各界讀者，尤其是青年、學生提供有益的精神養料。

高宣揚 謹識

一九八七年聖誕節前夕於巴黎

前 言

當代經濟理論上爭論的一些問題，並不是直接以大學教科書中的理論為基礎的，而是以所謂的“中級經濟理論”為基礎的，如一般均衡、社會福利、帕累托最優、外部效應、經濟信息、交易成本等等。過去二三十年，經濟學界對這些方面的理論進行了廣泛、深入的探討，許多東西已從最初的“前沿問題”，變成了大家共同接受的、作為討論基礎的理論內容，並被“收入”中高級經濟教科書，成為經濟系研究生必須掌握的內容，非此不能進入當今“前沿問題”的討論，不能把握今天經濟學的全貌，也很難對各種“流派”之爭作出科學的評判。本書的目的，便是較為系統地介紹一些（還不能說是全部）目前屬於“中級”經濟學理論的一些特殊的內容，力求使讀者對這些內容的基本思想、分析方法及相互聯繫，有一系統的理解。

所謂“中級”經濟學，與“初級”相比較，一方面是內容上的差異，另一方面是方法上的差異——中級經濟學更多地使用數理分析的方法，既包括初級教科書中已經開始使用的圖形描述和簡單的解析方法，也進而使用微分方程、高等代數、集合論等等較為高深的數學分析方法。從一定意義上說，不掌握一定的數理分析方法，就很難掌握

今天的經濟學，特別是“中級”以上的經濟學。數學方法不是經濟思想，但一定的數學方法的確有助於經濟思想的表達、整理與發展。第一，它有助於經濟思想更加精確、準確、嚴格，特別是在有關經濟變量關係的分析研究當中，就更是這樣。第二，它有助於提高理論的概括性，使複雜的經濟理論，得到更加簡明的表達，從而有助於思想的深化。比如，利用集合論的方法，可以將一系列的方程、無數的變量，濃縮為一個簡短的公式，從而既容易在思維中加以清晰地把握，又便於在論著中加以簡捷地表達。第三，數學方法特別是幾何圖形分析方法，更有利於使複雜的數量關係取得一種直觀的表達形式，有利於作者自己展開分析，也有利於讀者加以理解和把握。

本書中我們爲了介紹和分析當代“中級”經濟學的一些內容，也使用了一些數理方法，主要是那些已成爲在表達這些理論內容時通常必須使用的數理方法。不過，考慮到許多讀者可能對數理方法，特別是較深的數理方法不夠熟悉，我們在書中，第一，盡量將數理方法使用較多、較爲複雜的模型，轉化爲對數理方法要求不高的較爲簡明的模型，比如將多變量模型減化爲單變量模型，用較簡單的方法，說明理論的基本內容；在可不使用數理方法的地方，就主要採用文字敘述。第二，對理論內容本身，都作了文字敘述。不熟悉數理方法的讀者，將數理分析部分略去不讀，也可以把握理論的基本思想。

目 錄

前 言	v
第一章 一般均衡理論	1
第一節 導論：一般均衡理論的基本概念	1
第二節 交換均衡	7
第三節 生產均衡	16
第四節 均衡點的變化與均衡的實現過程	35
第二章 市場均衡與社會福利	49
第一節 福利經濟學的基本內容	50
第二節 經濟效率與帕累托最優	63
第三節 帕累托最優與市場均衡	75
第三章 經濟信息、交易成本與外部效應	85
第一節 價格信息搜尋與市場均衡的結構	86
第二節 信息不對稱與信息顯示	95
第三節 交易成本	111
第四節 外部經濟效應	126
第四章 公共選擇與政府管制	141
第一節 公共商品	142
第二節 公共選擇理論	152
第三節 政府管制	163

第 1 章

一般均衡理論

要全面地認識市場經濟的各方面特點，首先要全面地了解市場經濟的運行方式。在這個基礎上，我們才能根據效率的標準，對它的運行結果進行判斷，並進而研究“市場失效”的各種原因。

全面而綜合地分析、描述整個市場體系運行方式的理論，就是所謂的“一般均衡理論”。因此，我們需要首先對一般均衡理論作一系統的闡述。

第一節 導論：一般均衡理論的基本概念

本節我們先對一般均衡理論的基本內容和它的一些基本假定作一概括性的說明，以後各節再對其作詳細的闡述。

一、個別市場與市場體系

經濟學在分析市場結構和市場供求關係的時候，通常是就一個市場展開分析的。但是在一個經濟中不僅僅存在一個市場，而是存在多個市場；不是存在一種市場，而是

存在多種市場。首先，產品（包括服務）是多樣的，有多少種產品，就存在多少個市場；其次，市場不僅指產品市場，而且也指要素市場，包括勞動市場和資本（這裏指實物形態的資產，assets）市場，此外還有金融貨幣市場，等等。由各種市場組成的市場的集合，就稱為市場體系。一個經濟的制度特徵，不僅是由市場的存在與否所決定的，也是由市場體系的完全性所決定的，市場不完全是產生某些經濟問題的重要原因之一。本章中我們將假定產品、服務市場和要素市場是完全的，著重研究各種市場之間的相互關係。

二、局部均衡與一般均衡

假定除所研究的市場上的價格之外，其他一切市場上價格都給定不變，僅僅分析這一個市場上的供求關係及價格的理論，就稱作“局部均衡”理論。而“一般均衡”理論模型的特點就在於，在此模型中，一切價格和供求數量都是內生變量；在一般均衡點，一切市場上的供求數量都相等，也就是都實現了市場“清了”（clear）。顯然，第一，一般均衡理論是建立在局部均衡理論基礎之上的，但一般均衡理論又包含了局部均衡理論的內容；第二，局部均衡理論研究的是一種市場價格本身如何決定，而一般均衡理論的特徵，則在於它研究的是各個市場、各種價格之間的普遍的相互依存、相互影響和相互決定。在現實中，市場經濟體系是一個內部有機統一的整體，其中每一個變量的

變動，都會以某種方式影響其他變量的決定；一個“角落”上的變動，會波及到其他最遠的“角落”，“一切決定於其他一切”。^①換言之，一般均衡理論的特點就在於它放棄了局部均衡理論中“假定其他一切不變”這一抽象分析前提。從這個角度說，一般均衡理論比局部均衡理論更加具體，更加接近於現實。

三、交換均衡與生產均衡

在一般均衡理論的分析中，爲了便於清晰地說明各種問題，需要區分交換均衡和生產均衡。在交換均衡模型中，假定人們只是在市場上相互交換他們已有的東西，而不管這些東西是否是通過生產而創造出來的；在這種假定下構造的模型，也稱爲“純交換經濟模型”。在生產均衡模型中，則進一步引入企業（廠商）行爲和生產過程，研究生產技術在經濟體系中的作用。交換均衡模型有利於抽象地分析市場經濟中一切與商品交換有關的問題，而生產均衡模型包括了交換均衡理論的內容，在它的基礎上進一步分析市場經濟中的生產活動。

四、外定條件與市場變量

一般均衡理論分析一切市場的相互依存關係，但需要明確的是，一般均衡理論並不研究一切經濟變量變動的原因。

經濟因素或經濟變量可分爲兩種：“外生變量”和“內

生變量”(有人也將其稱為“參數”和“變數”)。所謂“外生變量”，簡單地說可以理解為事先給定的數量或因素，它不是由所考察的經濟體系本身內部決定的；而“內生變量”則是在給定的“外生變量”的基礎上，由經濟體系內部的各種關係、各種變量在相互作用中決定的。比如，一個經濟有多少畝土地，是“老天”給定的，因此應被視為一“外生變量”，而這個經濟某一年生產了多少糧食，則是由勞動投入量、人們對糧食的需求等因素在這個經濟的內部決定的，因此應被視為“內生變量”。

不過，根據所考察的經濟問題的特殊性質和特殊角度，外生變量與內生變量的劃分或選擇可以是不同的。比如，在局部均衡理論中，由於所考察的對象是一個市場，一種價格，因而可將“其他市場上的價格”視為“外生變量”；而在一般均衡理論中，理論的任務是研究各種市場、各種價格之間的相互關係，因此就不能再把任何一種價格視作外生變量，而是必須把它們都當成內生變量對待。

那麼，是否任何經濟因素或經濟變量在一般均衡理論中都是內生變量呢？也不是的。一般均衡理論所考察的內生變量仍有其特殊的界限，從而仍將某些經濟因素視為其理論模型的外生變量。在一般均衡理論中，作為內生變量的是一切市場價格 ($p_j, j=1, 2 \cdots m$) 和商品供求數量 ($x_j, j=1, 2 \cdots m$)。主要的外生變量包括：

1. 個人的效用函數。用 u_i 表示, $i=1, 2 \cdots n$, n 代表消費者人數。

2. 生產要素數量。如勞動時間、礦產和土地等，統一用 w_j 表示， $j=1, 2, \dots, m$ ，代表要素種類。由於假定時間、土地等都是可以直接消費的，因此，要素種類與消費品種類的數目是相同的（都有 m 種），所不同的僅在於，作為生產要素的物品，在所考察的時間範圍內是一個經濟“先天”擁有的數量，是人們的“稟賦”（Endowments）；而作為消費品，則是所考察時期內經過生產所進行的物質變換而形成的、並最終進入人們消費的產品數量。

3. 生產技術或生產函數。在一般均衡分析中，通常假定生產技術是給定的。但這並不是說生產技術是唯一的。生產同一種產品，可能有不同的生產技術，它們在一定時期內都是可行的。因此，“生產技術為一定”，實際是說“可選擇的技術範圍”是一定的。

4. 經濟體制。由於一般均衡理論所研究的就是市場經濟的運動過程，因此私有制的市場經濟制度這個前提假定總是不變的。進一步需要明確的假定是“市場結構”或“市場組織”。一般地，一般均衡理論假定市場是完全競爭的，不存在壟斷或者對價格或交易數量的限制（固定價格或配額）。完全競爭市場的特點可歸結為“平均成本等於價格”。

5. 財富分配狀況。給定了私有制這一特定的財產關係，與市場均衡相關的一個因素就是財富在不同的個人之間的分配比例。這裏，財富分配可以廣義地理解為各種生產資源（“稟賦”）的分配，即每個人所擁有的各種“稟賦”要

素（勞動能力、資本和土地等等）在資源總量中所佔份額比例的大小；不同的分配比例，會導致社會總需求結構的差異和相對價格的差異。

其他作為外生變量存在的還有：信息的完全程度、自然狀態（state of nature）等等。此外，一般均衡理論所採取的一個基本假定是“理性行為假定”：消費者最大化各自的效用，廠商最大化各自的利潤。這一最大化行為假定，構成一般均衡理論邏輯推導的基礎。

外生變量在這裏也稱為“外定條件”（data），即在經濟體系之外給定的、作為變量分析前提條件存在的各種經濟因素。一般均衡理論就是在一組特殊的外定條件下，研究經濟體系內部各市場之間的相互依存關係和各種內生變量的決定過程。它能夠說明，任何一個外定條件的變化，都會引起經濟體系中各種變量的變動和“均衡點”的改變。但是，一般均衡理論不研究(1)外定條件本身變化的原因（比如經濟制度變化的原因或技術進步的原因），以及(2)內生變量的變化對外定條件所處狀態的影響。

一般均衡理論所採取的各種特殊前提、假定，我們還將在下面逐步說明。在考察了一般均衡理論的內容之後，在本書的後面章節裏，我們將具體研究某些外定條件的改變會引進哪些特殊的經濟問題，並說明現實經濟條件與一般均衡理論所採取的各種假定之間的差距。

五、理論史簡述

一般均衡理論的起源最早可追溯到魁奈(Quesnay)的“經濟表”。馬克思(K. Marx)的“社會再生產圖式”則將“經濟表”所描述的“靜止狀態”的簡單再生產擴展為“擴大再生產”。現代一般均衡理論的公認創始人是列昂·華爾拉士(Leon Walras)。作為邊際效用學派的創始人之一，華爾拉士把個別經濟行為主體的最大化行為與市場普遍的供求均等結合起來，並用較為嚴謹的數學方式對市場一般均衡體系進行了描述，提出了如均衡“存在性”、“唯一性”、“收斂性”等一般均衡理論所需研究的各種問題。

“洛桑學派”的另一主要代表人物帕累托(V. Pareto)則在華爾拉士體系的基礎上，對市場均衡的社會福利涵義進行了研究，提出了一些至今仍作為分析基礎的理論命題。本世紀三十年代以後，希克斯(J. R. Hicks)等人對華爾拉士的理論“重新發掘”，使一般均衡理論的各種命題更加具體化並得到廣泛的應用和發展；列昂惕夫(Leontief)的“投入——產出分析”則被認為是應用一般均衡理論的一個重大發展。就“純理論”而言，當代一般均衡理論的權威著作是德布勒(G. Debreu)的《價值理論》(1959)。該書用現代數學方法對一般均衡理論的基本問題進行了重新論證和重新表述，但在思想內容上並無多少新的發展。

第二節 交換均衡

市場經濟首先表現為一種實行商品交換的經濟——無

論物品是人們生產出來的還是先天擁有的，人們用它們來相互交換，互通有無，互惠互利；沒有商品交換，就談不上市場經濟。因此，人們的商品交換行為，是分析市場運行機制時所需分析的第一個要素。在獨立地分析了這一要素之後，我們才能進一步引入生產的因素，並將交換和生產結合起來進行分析。

一、行為主體與商品

經濟學中所說的“商品”(goods, 中文也譯為“物品”或“財貨”)，是一個廣義的理論概念。在不同時間、不同地點或不同的自然狀態下出現的物品，都可視為不同的商品；服務，比如說勞務，也是一種商品。一般均衡理論假定對每一個商品都存在一個特殊的市場，該商品的價格便在這一市場上決定。

在一個“純交換經濟”的理論模型中，唯一的經濟行為主體(Economic Agents)，便是消費者，他為了消費的目的而進行商品交換。設有 n 個消費者，每個消費者 i 的特徵，便是他的特殊的偏好或效用函數 u_i 和他在交換之前所擁有的各種商品即他的一定數量的各種“稟賦” w_i 。效用函數的一般形式是：

$$u_i = u(x_i^1, x_i^2 \cdots x_i^m) \quad (1.1)$$

式中的 $x_i^1, x_i^2 \cdots x_i^m$ 分別代表不同的消費品，一定數量的各種消費品就構成一種“消費集”(Consumption Bundle，一譯“消費束”)。函數表明，消費者不是只消費一種商品，