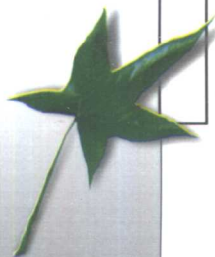


ZHONGQINGNIAN JINGJIXUEJIA WENKU

中青年

经济学家文库



经济效率 因素分析

王 稳 / 著

JINGJI XIAOLV YINSU FENXI



经济科学出版社

中青年经济学家文库

经济效率因素分析

王 稳 著

经济科学出版社

责任编辑：漆 熠
责任校对：王苗苗
版式设计：代小卫
技术编辑：董永亭

经济效率因素分析

王 稳 著

经济科学出版社出版、发行 新华书店经销

社址：北京海淀区阜成路甲 28 号 邮编：100036

总编室电话：88191217 发行部电话：88191540

网址：www.esp.com.cn

电子邮件：esp@esp.com.cn

大宇星印刷厂印刷

河北三佳装订厂装订

850×1168 32 开 9.5 印张 250000 字

2002 年 8 月第一版 2002 年 8 月第一次印刷

印数：0001—2000 册

ISBN 7-5058-3167-4 / F·2530 定价：21.00 元

(图书出现印装问题，本社负责调换)

(版权所有 翻印必究)

作者简介

王稳，博士，北京师范大学心理学博士后流动站研究人员，对外经济贸易大学金融学院副教授。主要研究方向：经济效率理论、制度经济学、国际金融、外汇交易与管理、行为经济学、金融心理学等。已出版著作多本，发表论文 50 余篇。

中青年经济学家文库

(已出版书目)

《东亚奇迹与“强政府”》
《市场论》
《跨国银行论》
《效率与供给经济学》
《论企业家行为激励与约束机制》
《现代资产组合理论与资本市场均衡模型》
《投资基金论》
《共生理论》
《要素市场发育与政府效率》
《中国出口增长奇迹》
《市场经济与财务管理》
《财政本质与财政调控》
《市场秩序论》
《中国人力资本形成及现状》
《产权置换、企业购并的理论及运行》
《转变经济增长方式与宏观金融调节》
《中国现代垄断经济研究》
《股票市场效率论》
《透视政府经济职能》
《经济发展中的税收政策》
《税收调控研究》
《市场社会主义》
《缩小地区差距的财政政策研究》
《中国财政扶贫研究》
《可持续发展的微观解理》
《现代社会的福利制度》
《中国经济发展中财政政策与货币政策》
《企业重组与金融创新研究》
《中国经济发展中的就业问题及其对策研究》
《可持续发展预警系统理论及实践》
《行为金融理论与投资策略选择》
《金融风险控制与国有经济安排研究》
《经济效率因素分析》

图书在版编目 (CIP) 数据

经济效率因素分析 / 王稳著. —北京: 经济科学出版社, 2002.9

(中青年经济学家文库)

ISBN 7-5058-3167-4

I. 经 ... II. 王 ... III. 经济效率—研究
IV. F014.9

中国版本图书馆 CIP 数据核字 (2002) 第 066518 号

序

王稳同志是我指导的博士毕业生，取得博士学位后，到对外经济贸易大学任教，现在北京师范大学心理学博士后流动站工作。他在攻读博士期间，不仅能够全部完成规定的博士学位课程，而且能够对学习的课程深入进行思考，结合实际研究，提出一些创新性的看法，是一个勤奋学习和有一定创新见解的同志。工作中，他花了很大力气对其博士论文进行了修改，形成了现在这本著作。在出版之际，要我作序，我欣然应允。

提高经济效率是推进人类社会经济发展的基本途径，经济效率的不断增长是经济活动主体长久追求的目标。因此，揭示经济效率的本质和特征，分析和探讨决定和影响经济效率的各种因素，寻求促进经济效率的提高的途径是一个十分重要的理论和实践课题。

这些年来，我国经济理论界和经济管理实践中对经济效率问题是比较重视的，就有关问题进行过种种探讨，但我认为对这个问题进行系统的深入的研究仍不够。

实际上，无论从理论上和实践上来说，经济效率问题都是一个具有重要意义的问题。首先，经济效率是经济学永恒的主题。无论是马克思主义政治经济学、还是西方经济学都说明了这一点。其次，经济效率的不断增长是社会主义市场经济建立和发展的根本保证。经济效率增长是一个社会制度存在和发展的基础，一种社会制度能够促进生产力的发展，进而促进经济效率的不断增长，它就能够兴旺发达，否则它就会走向衰退。再次，经济效

率约束是社会主义市场经济运行的常态。而有些经济学家较多关注的是需求约束或供给约束，但“经济效率约束”则更能揭示社会主义市场经济运行的实质。最后，经济效率规律是一个普遍规律，对经济效率规律人们必须要认识它、遵循它、利用它，才能用它为推动社会经济发展服务，否则，它就会像房屋倒在人的头上是重力定律强制地为自己开辟道路一样，给违犯者以应有的惩罚。

王稳同志的著作坚持以马克思主义理论为指导，批判吸收西方经济效率理论的合理成分，并结合我国的实践，揭示经济效率的本质和内涵，研究经济效率的度量和评价方法，建立经济效率函数模型，在此基础上对影响和决定经济效率的主要因素，即金融因素、知识和技术因素、结构因素和制度因素进行全面系统的分析，建立了一个比较完整的经济效率因素分析框架，对有关经济效率的一系列重大问题提出了自己独到的见解和创新。

- 本书对经济效率的含义和实质作出了正确的解释。经济效率是对经济活动的投入和产出之间的内在联系和比率关系的描述，是经济运行的客观过程的反映，而且它本身是一个不断发展变化的运动过程，这一运动过程的实质概括了人类所有经济活动的实质，即社会必要劳动时间的节约。这是本书的一个创新见解。

- 本书还把决定和影响经济效率的各个互相独立的因素纳入一个统一的分析框架。具体地说，他是在生产函数的基础上建立经济效率因素分析模型，而由于劳动和资本是影响经济效率的直接因素，因此，假定投入和产出是外生性的、不变化的。这也是本书研究经济效率的一个创新见解。

设经济效率函数 $E = F(M, S, T, L)$ 为 C—D 型函数，即

$$E = AM^{\alpha}S^{\beta}T^{\gamma}L^{\phi}$$

其中 E 为经济效率， M 为金融因素， S 为知识和技术因素，

T 为结构因素, L 为制度因素, A 为系数。 α 、 β 、 γ 、 Φ 为大于 0 的常数。

对经济效率函数取对数有:

$$\ln E = \ln A + \alpha \ln M + \beta \ln S + \gamma \ln T + \Phi \ln L$$

对经济效率函数求全微分有:

$$\begin{aligned} (\ln E)' = E'/E &= \alpha (\ln M)' + \beta (\ln S)' + \gamma (\ln T)' + \Phi (\ln L)' \\ &= \alpha M'/M + \beta S'/S + \gamma T'/T + \Phi L'/L \end{aligned}$$

令, $e = E'/E$ 、 $m = M'/M$ 、 $s = S'/S$ 、 $t = T'/T$ 、 $l = L'/L$

则, $E'/E = e = \alpha m + \beta s + \gamma t + \Phi l$ (1)

式 (1) 的含义是, 经济效率的变化率是金融因素、知识和技术因素、结构因素、制度因素等诸要素变化率的加权和。

更进一步地, 我们有下列几个方程:

$$m = \alpha_1 m_1 + \alpha_2 m_2 + \alpha_3 m_3 + \alpha_4 m_4 + \alpha_5 m_5 \quad (2)$$

$$s = \beta_1 s_1 + \beta_2 s_2 + \beta_3 s_3 + \beta_4 s_4 \quad (3)$$

$$t = \gamma_1 t_1 + \gamma_2 t_2 + \gamma_3 t_3 \quad (4)$$

$$l = \Phi_1 l_1 + \Phi_2 l_2 + \Phi_3 l_3 + \Phi_4 l_4 \quad (5)$$

式 (2) 表示金融因素效率的变化率 (m) 是金融发展 (m_1)、金融监管和创新 (m_2)、金融压抑和自由化 (m_3)、直接金融和间接金融效率 (m_4)、有效率的金融机构体系 (m_5) 等诸变量效率的变化率的加权和, 各个变量前面的系数为该变量的权重。式 (3) 表示知识和技术因素的效率的变化率 (s) 是人力资本积累 (s_1)、研究发展 (s_2)、知识积累和外溢 (s_3)、技术的扩散 (s_4) 等诸变量效率的变化率的加权和。式 (4) 表示结构因素效率的变化率 (t) 是结构的演进 (t_1)、产业组织 (t_2)、地区结构 (t_3) 等诸变量效率的变化率的加权和。式 (5) 表示制度因素效率的变化率 (l) 是政府管理效率 (l_1)、产权制度 (l_2)、组织效率 (l_3)、法律制度 (l_4) 等诸变量效率的变化率的加权和。

在这个分析框架中，经济效率的各种因素不再人为地割裂，而是共享一个统一的分析框架，从而大大提高对经济效率变化的解释力和预测力。

• 本书详细分析了经济效率诸因素的作用机理、方式和途径。本书坚持历史和逻辑相统一的马克思主义分析方法和原则，对影响和决定经济效率的主要因素，即金融因素、知识和技术因素、结构因素和制度因素作用的机制和方式进行了分析。

金融因素对经济效率增长的作用，主要是通过降低资源配置和交易成本的方式来实现的。同时，金融体系还具有监督功能，通过降低经济运行的风险、增加流动性和传递信息等，以保证金融资源具有持续的效率。良好的金融体系会合理地配置资源，而低效率的金融体系则会把资源配置给低效率的生产部门。因此，金融因素是决定经济效率的首要因素。

知识和技术因素是决定和影响经济效率关键性和核心性的因素。它主要是通过改进劳动者技能和劳动资料的技术水平等其他因素的素质，提高要素生产率，降低资源利用和配置成本的方式来实现经济效率增长的。一方面是以物质资本为载体，通过科学技术的发明和创造，生产出先进的生产工具，应用于生产过程，同时，扩大劳动对象的范围，改变和提高劳动对象的质量，大大提高生产力和经济效率。另一方面是以人力资本为载体，通过学习和教育，促进人力资本的知识积累，增进劳动者的专业知识与技能，从而降低整个经济的生产成本，促进经济效率的提高。

结构因素是决定和影响经济效率的关键因素。经济效率的一个重要含义是经济资源和社会必要劳动时间在不同部门、产业和企业之间的配置，因此，反映社会经济运行的部门、产业和企业不同比例关系的结构因素，是决定经济效率的关键因素。从理论上说，结构因素对经济效率的作用方式可以从几个方面来讨论，首先是结构的静态均衡和动态演进问题，它是经济效率增长的一

个关键变量；其次是结构的组织问题，合理的产业组织和规模是影响经济效率高低的至关重要的因素；第三，从经济效率角度看，结构的调整与演进必须以经济效率的提高和增长为原则和标准。

制度因素是经济效率增长的能动因素。制度因素之所以对经济效率的增长具有能动作用就在于，制度最基本的功能是节约，即让一个或更多的经济人增进自身的福利而不使其他人的福利减少，或让经济人在他们的预算约束下达到比他们预期的更高的目标水平。一个效率较高的制度，能够减少交易成本，防止个人和团体犯错误，激励个人和组织从事生产活动，减少个人收益与社会收益之间的差异，进而极大地提高经济效率。在制度因素和经济效率的关系中，包含一定经济效率水平的生产力是制度变迁和创新的根本性决定因素，不坚持这一点就不是坚持马克思主义；同时，制度因素又具有巨大的能动作用，不承认这一点就是把马克思主义庸俗化。

当然，本书也有一些不足之处，关于公平与效率的争论，学术界由来已久，本书对此没有深入探讨，是一个缺陷。另一个的缺憾是不能涵盖所有影响经济效率的因素，其中一个重要的因素就是自然条件，它作为经济效率的影响因素愈益重要，经济效率因素分析理论是不能忽视这一因素的。尽管如此，瑕不掩瑜，该书对经济效率问题的探讨和分析是极具现实意义的，因此，我愿意为之作序，并愿推荐给读者批评指正。

宋 涛

2002年5月20日于中国人民大学科研楼

目 录

序	1
第一章 导论	1
一、历史的回眸	2
二、现实的思索	8
三、本书的逻辑	17
第二章 经济效率的一般性说明	20
第一节 经济效率的含义和实质	20
第二节 经济效率的度量和评价	35
第三节 经济效率的分类度量和评价	53
第三章 经济效率的决定和影响因素	63
第一节 前人文献的回顾	63
第二节 经济效率的决定和变化	70
第三节 经济效率因素分析模型	76
第四章 金融因素	79
第一节 金融因素是决定经济效率的首要因素	80
第二节 金融的深化发展和效率	86
第三节 金融监管和金融工具的创新	92
第四节 金融压抑和金融自由化发展	96
第五节 直接金融效率和间接金融效率	102
第六节 有效率运作的金融机构体系	112

第七节 以金融因素促进经济效率提高的对策	114
第五章 知识与技术因素	123
第一节 知识和技术因素是经济效率增长的源泉	123
第二节 人力资本积累的效率	132
第三节 研究开发 (R&D) 效率	141
第四节 知识积累和外溢效率	147
第五节 技术的引进和扩散效率	153
第六节 以知识和技术进步推进经济效率的增长	155
第六章 结构因素	165
第一节 经济结构是决定和影响经济效率的关键 因素	165
第二节 经济结构的均衡和演进效率	175
第三节 产业组织和规模效率	188
第四节 地区经济结构效率	196
第五节 以结构调整推动经济效率提高的对策	200
第七章 制度因素	206
第一节 制度因素是经济效率增长的能动要素	207
第二节 政府管理效率	216
第三节 产权制度效率	227
第四节 组织效率	239
第五节 法律制度效率	245
第六节 以制度变革和创新推动经济效率的增长	256
第八章 结论	267
主要参考文献	273
后记	288

第一章 导 论

如果你想思考，你就去思考，不要管上帝是不是会发笑。

——作者

1. 本书是我长期研究经济效率问题的阶段性总结，主要研究经济效率是什么？影响经济效率的因素是什么？经济效率问题是经济学人最应该关注和探讨的，一个浅显的道理是，一个国家、一个民族、甚至一个人的成功和具有竞争力是建立在他拥有和掌握某种资源的基础上，只有能够汇集、调用资源的主体才能够获得成功，而这必须以经济效率作为前提，因而一个资源中心必须是经济效率中心。如果失去效率，那么资源就会脱离中心，中心地位也会渐渐失去，而在另外的相对效率较高的地方重新形成中心，这种情况在现实经济运行中无时无刻不在发生。经济效率是决定国家、民族甚至个人兴衰存亡的关键。

2. 从经济学角度说，经济效率是经济学理论和实践的永恒主题之一，经济效率规律是市场经济运行的重要的和基本的规律，经济效率约束是市场经济运行的常态，也是我国社会主义市场经济运行的常态，经济效率的不断增长和提高是社会主义市场经济发展的根本保证，因此，揭示经济效率的本质和特征，分析和探讨决定和影响经济效率的各种因素，寻求促进经济效率的提高和增长的途径是十分重大的理论和实践课题。

一、历史的回眸

3. 从前人的文献看，西方经济学有关经济效率的理论具有比较完整的理论体系，但不一定完全适合我们的实际，而马克思主义经济学还没有形成系统的经济效率理论，不适应社会主义市场经济和马克思主义经济理论发展的要求。因此，从理论上和实践上来说，都有必要研究经济效率问题，对决定和影响经济效率的因素进行分析。

4. 马克思、恩格斯没有提出自己明确的经济效率理论，他们的经济效率思想贯穿在《资本论》以及相关著作构成的整个理论体系中，是与劳动价值论、剩余价值论、资本积累理论、资本循环和周转理论、社会资本再生产理论等联结在一起的。列宁、斯大林、毛泽东、邓小平等经典作家进一步发展了马克思主义这一光辉思想。

5. 原苏联和东欧国家的理论界对经济效率的问题进行了很多的探讨。原苏联理论界关于经济效率问题的讨论，大致可划分为三个阶段：早期的探讨与发展阶段；50年代的探索与争鸣阶段；60~80年代的新探索阶段（张德霖，1992）。

原苏联早期著名的劳动生产率理论方面的经济学家有斯特鲁米林。他对劳动生产率理论的贡献是创造了劳动生产率指数，即“斯特鲁米林指数”。从50年代起，苏联的一些经济学家对劳动生产率提高规律是一个普遍的或一般的经济规律、还是社会主义制度下特有经济规律、抑或是这个普遍经济规律在社会主义条件下转变为特有经济规律问题，进行了广泛的讨论。从60年代末到80年代，原苏联理论界对劳动生产率理论的探讨进入了一个新的阶段，就有关劳动生产率的许多重大问题进行了探讨，诸如劳动生产率范畴、劳动生产率提高规律的性质、劳动生产率与劳动强度的关系、管理劳动的生产率以及劳动生产率的指标和计量

方法等，这一时期比较著名的学者主要有阿巴尔金、拉祖连科等人。90年代以来，随着原苏东国家的剧变，对社会主义经济的劳动生产率问题的研究和探讨也就中断了，没有也不可能形成完整的社会主义市场经济效率理论。

6. 我国经济学家对经济效率问题也做出很多的探讨。我国的经济效率研究历史始于50年代末期，可把它分为两个阶段、四次研究高潮（张先治，1996）。第一阶段是从50年代末到80年代初，主要开展经济效果的讨论与研究，出现了两次研究高潮，一次是从50年代末到60年代初，主要是就经济效果的含义和实质、经济效果研究的范围、经济效果的评价指标进行讨论。另一次是从70年代末到80年代初，主要是讨论经济效果的概念、经济效果的指标、经济效果与调整、改革的关系，分析我国建国以来经济效果差的原因。从60年代中期到70年代中期的10余年，由于“文化大革命”，经济效果问题被严重忽视，出现了研究的空白。第二阶段是从80年代初至今，主要开展经济效益的研究，有两次高潮，一次是从80年代初期到80年代中期，另一次是从80年代末至今。广泛讨论了经济效益的含义、指标体系，分析改革开放以来我国经济效率的状况，提出促进我国经济效益提高的措施和政策。

我国研究经济效率问题的学者很多，比较著名的有孙冶方、于光远、宋涛、李京文等。孙冶方曾指出：“什么是经济呢？就是以最小的耗费，取得最大的效果。”他又指出：“一切经济问题的秘密就在于如何可以更少的劳动获得更多的产品，或者说就在于如何使同样的劳动时间生产出更多的产品，也就是如何减少生产每单位产品所需要的劳动量。”还指出：“发展生产的秘诀就在于如何降低社会平均必要劳动量，在于如何改进技术、改善管理的办法，使少数落后企业的劳动消耗量（包括活劳动和物化劳动）向大多数中间企业看齐，使大多数中间企业向少数先进企业

看齐，而少数先进的企业又如何更进一步提高。落后的、中间的和先进的企业为了降低社会平均必要劳动量水准而不断进行的竞赛，也就是生产发展、社会繁荣的大道”。他指出了提高经济效益的途径：“一个就是改善国民经济和企业管理，一个就是不断地进行技术革新、技术改造。”

刘国光于1962年曾说，内涵与外延扩大再生产的区别是劳动生产率，内涵扩大再生产就是“以质量效果更高的劳动手段代替质量效果较低的劳动手段，要求以更多的生产资料来装备劳动者”。他强调指出：“今后决不能再搞追求数量指标，光靠上新项目、铺新摊子、增加能源和原材料消耗等等外延扩大再生产的方式来发展生产，而要重视质量和效果，主要依靠现有企业挖潜革新改造，充分发挥它们的作用，用提高劳动生产率、节约能源原材料等等内含扩大再生产方式来发展生产。”

于光远于1978年曾说：“经济效果就是对人们为达到某一目的而进行的实践活动所作的关于劳动占用或劳动消耗的节约程度的评价。”

李京文等1988年同美国著名经济学家乔根森以及日本经济学家黑田昌裕用数量分析方法合作研究了中美日的生产率及其在经济增长中的作用。

史清琦等人运用丹尼森的方法研究了技术进步及全要素生产率在中国经济增长中的作用。

宋涛于1996年说：“工业经济效益，是指全部国有工业在一个生产周期内投入与产出的比；工业企业的经济效益，是企业在一个生产周期内投入与产出的比。”

7. 总之，虽然我国理论界对经济效率有关问题进行过种种探讨，并且初步形成了一个经济效率理论体系。但缺乏系统的深入的研究，特别是对马克思的经济效率思想总结和挖掘不够，对它的现实指导意义重视不够。社会主义经济效率理论还存在许多