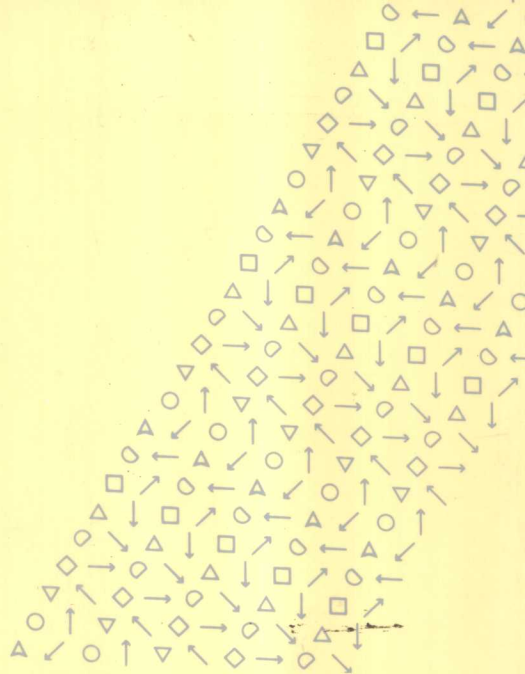


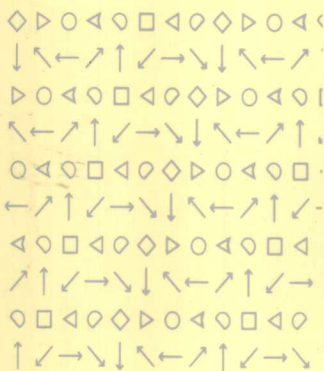
当代经济学系列丛书

Contemporary Economics Series

主编 陈昕



在交易成本 不为零条件下的 一般均衡分析



当代
经济学
文库

谢志平 著



上海三联书店
上海人民出版社

当代经济学系列丛书

Contemporary Economics Series

主编 陈昕

在交易成本 不为零条件下的 一般均衡分析

谢志平 著

当代
经济学
文库



上海三联书店
上海人民出版社

图书在版编目 (CIP) 数据

在交易成本不为零条件下的一般均衡分析/谢志平著.
上海: 上海人民出版社, 2006
(当代经济学系列丛书. 当代经济学文库/陈昕主编)
ISBN 7-208-06287-0

I. 在... II. 谢... III. 一般均衡论-研究
IV. F019.1

中国版本图书馆 CIP 数据核字(2006)第 052936 号

责任编辑 张菲娜
装帧设计 敬人设计工作室
吕敬人

在交易成本不为零条件下的一般均衡分析

谢志平 著

上海三联书店
上海人民出版社

200001 上海福建中路 193 号 www.eswen.cc



上海世纪出版股份有限公司
高等教育图书公司 出品

世纪高教 www.hibooks.cn

上海福建中路 193 号 24 层 021-63914988

世纪出版集团发行中心发行

上海市印刷七厂印刷

2006 年 12 月第 1 版

2006 年 12 月第 1 次印刷

开本: 850 × 1168 1/32

印张: 7 插页: 6 字数: 141,000

ISBN 7-208-06287-0/F·1422

定价: 17.00

作者近照



作者简介

谢志平，男，祖籍湖南祁阳，1963年6月出生，出生于广西平桂。1979—1984年在清华大学工程物理系反应堆专业学习，1984—1986年在清华大学经济管理学院学习经济学。1986年毕业分配到湖南大学经济管理系教书。2003年9月到山东大学经济研究中心攻读博士，2005年6月获博士学位。现为山东大学经济研究中心教师。

长期以来，主要从事认知科学、认知哲学、经济学等方面的基础理论研究。1999年开始研究一般均衡理论。在《经济研究》等杂志上发表论文十余篇。

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,我们决定出版“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。它包括三个子系列:(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。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”则主要出版国外著名高等院校的通用教材。

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。

致 谢

感谢我的导师黄少安教授的悉心指导。感谢我的朋友肖乐军、袁秋萍、孙涛在我查询文献时给予的帮助。感谢所有在我的研究工作中帮助过我的老师和朋友。

序

谢志平，2002年我在杭州参加学术会议时认识了他，知道了他正在研究什么，也知道了他当时的处境。我觉得这个人学术水平不低，更为重要的是他对经济学研究的独特视角和痴迷。他有从事经济学研究的良好知识结构——1979级清华大学工程物理系本科，1983年又考取清华大学经济管理学院研究生班，毕业后一直在湖南大学从事微观经济学和宏观经济学的教学。出于对人才（包括潜在的人才）的爱惜和促使人才配置的优化，我建议他尽快到山东大学经济研究中心来工作，并建议他立即报考博士研究生。可是，他连硕士学位都没有，不符合山东大学引进人才的有关政策，好在山东大学领导和人事部门的同志相信了我的推荐，很快接受了他，于是他顺利考取了山东大学的博士生。

跟他在一起，任何情况下他都大谈他的学问。他的这种痴爱是有回报的。攻读博士学位期间，已经取得重要成果。鉴于他的学

术水平和成果,学校学位管理部门同意他提前答辩并顺利通过。《在交易成本不为零条件下的一般均衡分析》就是他的博士学位论文。最近,他又在学位论文的基础上作了一些修改,作为学术专著出版。

作为他的博士论文指导老师,指导的过程其实也是向他学习的过程。论文中的大量数学推导,我其实不懂。但是,我能告诉他怎么选题、必须解决哪些重要问题。交易成本理论和一般均衡理论都是现代经济学研究的重要领域,两者发展都很快,研究成果非常多,但是把这两者结合起来,选题作博士论文却是极富挑战性和创造性的,极有可能有所创新,而且是基础理论层面上的重要创新。

这本著作分析的逻辑起点是交易成本的固定项不一定为零(为零只是其中一个特殊情形)、存在生产部门、货币是交易的媒介,在以下一些方面的创新和认识是值得关注的:

第一,对于一些特定的假设前提,如果明显是与现实经济活动相违背的,原则上就可

以在理论上重新构建分析的基础,而因此得到的相关结论可能是非常有价值的,在这本著作中,这一看法就体现得很明显。但是并不是说简单的分析框架就没有存在的必要,实际上,它们提供了一切复杂和深入分析的基准(benchmark)。作者正是在主流经济学既有的研究成果上进行理论创新,在一些领域或环节,有重要的原创性进展。

第二,该著作使用了严谨的数理分析方法。数学逻辑和理性的力量始终是经济学研究所要借重的,对于著作中解析几何和动态(序贯)规划的工具,作者运用自如,可见作者数学功力,并且其中更多反映的是思维的缜密。不过,数学的工具性作用并不能替代经济内在逻辑的思考,这本著作对两者之间的关系作了很好的定位,从抽象的数学描述和严谨的经济解释两个角度论证了正交易成本条件下一般均衡的实现机制以及相关理论问题。

第三,作者指出在正交易成本情形下,如果市场因个体超额需求不连续而产生非无穷

小比例的交易者同步化决策,那么市场就不能依靠自身的力量实现出清。如果社会中所有经济个体间的协商成本不为零,那么采取计划的手段是惟一有效的,因为在每个个体超额需求不连续的地方,给定价格后,个体在断点之间的利益是无差异的。从这一意义上而言,当市场自动调节失灵时,经济管理部门的宏观调控是可行的甚至是必需的。这应当是我国经济转型时期需要非常注意的问题。

第四,作者在最后一部分特别对交易成本大于零时的福利效应进行分析,认为交易成本的存在破坏了福利经济学第一、第二基本定理的前提和基础,并从消费者的禀赋、交易支出和收入三个方面对社会福利造成巨大影响。接着,又提出了一种从宏观层面测度福利损失的方法,该问题一直是经济分析中的一个难点,作者做了一个重要并具有启发意义的尝试;著作还从理论上体现了交易成本对经济效率和社会福利的影响是具有放大效应的。

呈现给读者的这本著作既是作者在这一领域长期研究的一个阶段性成果,又是作者下一步研究的起点。我们希望他取得更大的成就。

黄少安

2005年7月

前言

中国正处于从计划经济向市场经济的转轨时期,所以研究市场经济的稳定性有着十分重要的意义。从一般均衡的角度研究市场经济的稳定性是新古典主义经济学的传统,到现在,西方的经济学家们也已经有了大量的研究成果。中国的国情有许多地方不同于西方国家,其中之一就是交易成本相对而言非常大,因此,研究在一般化的交易成本条件下的一般均衡具有十分重要、十分现实的意义。

简而言之,在西方经济思想体系中,证明一般均衡的存在具有划时代的意义,但遗憾的是,一般均衡的提出者 Walras 本人无法证明它。20 世纪 30 年代, A. Wald 通过假设效用函数和线性生产体系证明了一般均衡的存在,但是他的假设本身是难以让人接受的。所以我们通常说,是 Arrow-Debreu (1954) 首先严格地证明了在许多可接受的强假设条件下的瓦尔拉斯均衡的存在性。在此之后,许多经济学家投入了大量的精力去弱化那些

强的假设条件。比如, Debreu (1959) 引入了或然性, Hahn (1971) 建立了一个考虑存量和特殊交易成本的模型, Mas-Colell (1974) 证明了不要完全性和传递性的消费者偏好下的瓦尔拉斯均衡的存在性, Bewley (1972), 以及 Aliprantis 和 Brown (1983) 把商品空间发展到无限维, Quinzii (1984) 考虑了商品的不连续性, 等等。

交易成本在现实经济活动中是不可避免的。自从 Coase (1937) 提出交易成本这一概念, 交易成本在社会经济中的地位已经逐步地被经济学家们研究得越来越清楚。不同的经济学家对交易成本有不同的定义。但无论如何定义, 交易成本可分成两类: 一是建立市场制度所需的交易成本, 二是执行交易过程所需的交易成本 (参见黄少安, 1995)。因为前者对于交易者的理性选择而言是沉没成本, 故本研究只考虑后者, 并且是从每个个体独立承担的交易成本对其决策的影响角度来考虑的。

交易成本为零是 Arrow-Debreu (1954) 模型隐含的前提性假设。弱化这一假设的意义是不言而喻的。故把交易成本引入一般均衡框架是必然之举,经济学家们也为此作出了许多努力。

如同 Kurz (1974), 笔者最初的研究目的也只是想把一般情况下的交易成本引入到一般均衡框架中并证明其瓦尔拉斯均衡的存在性,从而全面弱化 Arrow-Debreu (1954) 中的交易成本为零的假设。但在证明存在性之后,在分析福利性质的过程中,却产生了一些意想不到的结果。

不言而喻,在一般均衡框架下弱化零交易成本假设是十分重要的,因为交易成本在现实经济活动中是无处不在的。比如,只要在信息本来就是不完全、不对称的经济世界里信息成本不为零,最起码信息成本就是一种非常重要的交易成本。如今信息经济学在主流经济学中已经占据了重要的一席之地(参见如: Stigler, 1961; Akerlof, 1970; Diamond

and Mirrlees, 1971; Spence, 1973, 2002; and Stiglitz, 1975, 1979)。不过,仍然有点遗憾的是,在信息经济学与一般均衡理论结合的过程中好像还缺了点什么,相信本书的把交易成本纳入到一般均衡体系的工作会对此有所帮助。此外,新制度经济学已经对许多与交易成本相关的问题进行了深入而全面的研究(参见如:Coase, 1937; Alchian and Demsetz, 1972; Williamson, 1979; Demsetz, 1968; Cheung, 1969),把交易成本纳入到一般均衡体系的工作毫无疑问地能够在一定程度上揭示新制度经济学与一般均衡理论和福利经济学之间的关系。

★ 最早在一般均衡框架下讨论交易成本的是 Foley(1970),他定义了一个销售价和一个购买价,两者之差是交易成本,这意味着他讨论的是线性齐次的交易成本(无固定项,交易成本与交易量成线性比例)。之后, Hahn (1971)和 Starrett(1973)建立了一个序列经济模型,该模型把社会看成一个大企业,所有