

当代经济学系列丛书

Contemporary Economics Series

主编 陈昕

宏观经济学： 非瓦尔拉斯 分析方法导论

当代经济学译库

[法] 让-帕斯卡尔·贝纳西 著

刘成生 朱远清 郭上沂 译
田善耕 蒋晓泉 费方域 校



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

宏观经济学： 非瓦尔拉斯 分析方法导论

[法] 让-帕斯卡尔·贝纳西 著
刘成生 朱远清 郭上沂 译
田善耕 蒋晓泉 费方域 校

当代
经济学
译库



世纪出版

上海三联书店
上海人民出版社

图书在版编目 (CIP) 数据

宏观经济学:非瓦尔拉斯分析方法导论/(法)贝纳西

(Benassy, J-P.)著;刘成生等译.

—上海:上海人民出版社,2006

(当代经济学系列丛书.当代经济学译库/陈昕主编)

ISBN 7-208-06121-1

I. 宏... II. ①贝...②刘... III. 宏观经济学
IV. F015

中国版本图书馆 CIP 数据核字(2006)第 013084 号

责任编辑 李 娜

装帧设计 敬人设计工作室

吕敬人

宏观经济学:非瓦尔拉斯
分析方法导论

[法]让-帕斯卡尔·贝纳西 著

刘成生 朱远清 郭上沂 译

田善耕 蒋晓泉 费方域 校

上海三联书店 上海人民出版社 200001 上海福建中路 193 号 www.ewen.cc  上海世纪出版股份有限公司 世纪出版 高等教育图书公司 出品 上海福建中路 193 号 24 层 021-63914988	世纪出版集团发行中心发行 上海商务联西印刷有限公司印刷 1990 年 7 月第 1 版 1994 年 11 月新 1 版 2006 年 3 月新 2 版 2006 年 3 月第 1 次印刷 开本: 850×1168 1/32 印张: 10.75 插页: 5 字数: 228,000
ISBN 7-208-06121-1/F·1390	定价:22.00



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。



译者的话

让-帕斯卡尔·贝纳西生于1948年,法国国家科学研究中心研究员,巴黎高等师范学院政治经济学研究室主任,经济学家。作为非瓦尔拉斯学派的代表人物之一,从20世纪70年代以来他发表了多篇有关非瓦尔拉斯均衡理论的论文,如“非均衡理论和宏观经济学中的微观经济学基础”、“数量信号和有效需求理论基础”等。并著有《市场非均衡经济学》(1982年)、《宏观经济学与非均衡理论》(1984年)、《宏观经济学:非瓦尔拉斯分析方法导论》(1986年)。这些论文和专著不仅反映了贝纳西本人的学术观点,也反映了近年来非瓦尔拉斯均衡理论的发展趋势。

西方经济学通常采用的分析方法是均衡分析。即通过市场价格(不仅包括商品价格,还有工资、利率等)连续不断的变

动,交易者根据价格升降和各自的特殊判断准则(对居民户来说是预算约束条件下的效用最大化,对厂商来说是技术约束条件下的利润最大化等)来调整其需求或供给,经过若干次反复,最终可以使市场上的需求与供给相等,此时即获得所谓的均衡价格。一切交易都是按照均衡价格进行的,市场上既无多余的需求,也无多余的供给。

很显然,均衡价格的形成是需要一定条件的:每个交易者都能够及时获得准确、完整的信息;价格的升降是完全自由的、灵活的、迅速的;市场上要有一个报价者,他犹如拍卖市场上的拍卖人,能够迅速地向交易者提供价格信息,而且在达到均衡价格之前不进行交易。在现实的经济中一般来说并不存在这些条件,因此交易不一定能够按照均衡价格进行,市场也不一定结清。非瓦尔拉斯分析方法正是研究在供需不相等的情况下市场是如何运行的一种方法。

非瓦尔拉斯均衡理论认为,完全依靠价格调整使供给和需求在一切市场、一切时间都相等的可能性很小,这是因为价格具有某种程度的刚性。而且市场上的非价格因素(如商品的差异、广告等)已部分取代了价格竞争,另外价格的调整也不完全是一个经济问题,有的还涉及社会、政治问题(如工资的

调整)。事实上,交易者在市场上不仅获得了价格信号,还获得了数量信号,例如,当市场出现供不应求的状况时,只要价格不能及时调整,处于需方的交易者就不能实现自己的意愿交易,只能按照实在的供给数量达成交易,于是他要受到数量配额的限制。相反,当市场出现供过于求的状况时,则是处于供方的交易者受到数量配额的限制。显然,交易者不仅要受到价格的约束,还要受到数量的约束。这种价格—数量混合调节正是非瓦尔拉斯分析方法的基础。

与数量调节有关的一个重要概念是“溢出效应”(spillover effects)。当一个交易者在一个市场上交换的东西比他希望交换的要少时,他就会调整自己在其他市场上的需求和供给,使一个市场的不平衡传递到另一个市场。对一个交易者的数量配额正是由其他交易者向市场表达的需求和市场中的特定组织所决定的。每个特定的组织和一种特定的配额方式相联系,例如有按比例分配货源或销路的形式,也有先来先买(或先来先卖)的排队分配形式等等。

由于非瓦尔拉斯分析方法比瓦尔拉斯均衡分析方法更接近现实,因而具有更多的优点。但是,正如贝纳西指出的:“非瓦尔拉斯分析方法不是‘反瓦尔拉斯’的,相反,借助于

更一般的假设,它应用了在瓦尔拉斯理论中已获得成功的一些方法。”

《宏观经济学:非瓦尔拉斯分析方法导论》是贝纳西的近期著作,在该书中,他综合了自己及其他非瓦尔拉斯学派经济学家的研究成果,对非均衡理论进行了更完善的阐述,并以数学规划为工具,构造统一的数学模型来对若干宏观经济问题进行范围广泛的研究,从而架起了一座沟通传统宏观经济学与现代非瓦尔拉斯均衡理论的桥梁。

在本书的前两章,贝纳西首先研究了非均衡条件下的交易者行为,精确地描述了各个市场的配额方案,证明了数量信号是如何形成的以及市场中的交易者又是如何根据价格和数量约束来实现最佳交易的。在此基础上,分别建立了固定价格、有界价格及垄断竞争的非瓦尔拉斯均衡等重要概念。

在本书的第二部分封闭经济模型中,作者将一些互相冲突的就业理论进行综合,统一到一个包含着三种状态的简化宏观经济模型中,并分别论述其适应性。这三种状态代表了劳动市场和商品市场非均衡的三种组合,即劳动市场和商品市场都供给过剩;劳动市场供给过剩商品市场需求过剩;劳动市场和商品市场都需求过剩。并通过更接近现实的价格假设,使模型更完善,论述了各种反失

业政策的效果。在一个综合的非瓦尔拉斯货币经济模型中,作者把三种 IS-LM 说法也概括为同一模型的三种状态。

在本书的第三部分,贝纳西进一步把模型扩展为两个国家的国际贸易综合模型,探讨在开放经济中的政策有效性,并考虑了预期在非瓦尔拉斯宏观经济模型中的核心作用,建立了预期方案可供选择条件下的动态模型。

当前,西方经济学仍然是以均衡分析为其主要的分析方法。但是,由于非瓦尔拉斯分析方法在实现西方宏观经济学与微观经济学的结合方面开辟了一条新的途径,它更加接近经济的实际情况,能够解释一些用均衡分析难以回答的问题,因而受到了更多的西方经济学家的重视。本书也有助于我们了解西方非均衡经济学的理论和分析方法。

非瓦尔拉斯均衡理论是以西方市场经济为背景产生的,但是它所提出的价格—数量调节,对于我们研究社会主义经济问题也有借鉴意义。非均衡理论提示我们,即使在比较发达的市场经济条件下,完全仰仗价格作用实现经济的瓦尔拉斯均衡的可能性也是很小的,就是实现了这种均衡,也只能是暂时的。在供需不平衡的情况下,只有通过价格和数量的共同调节,才能达到事后的均衡。

我国在发展社会主义有计划商品经济的过程中,将较长时期面临市场发育程度不够高,商品供需矛盾比较大的情况,在充分发挥价格机制调节作用的同时,重视数量调节(如重要物资的配额、信贷规模的计划控制等)的作用,完善数量调节的方式(这在西方非均衡理论中也是一个未解决的问题),显然是十分必要的。

本书的序言、导言、第1~5章由刘成生翻译,第6~11章由朱远清翻译,第12~14章及附录由郭上沂翻译。全书由田善耕、蒋晓泉初校,费方域复校。

本书的翻译及出版,得到陈昕同志的大力支持和帮助,在此谨表由衷的感谢。

由于我们的水平有限,译文难免有不妥之处,希望读者不吝指正。

1990年3月于成都



校者的话

(一)

就理论本身的完善而言,凯恩斯革命以后,宏观经济学的发展过程,在很大程度上就是把它同微观经济学的不协调、不一致的关系改变为相协调、相一致的关系的过程。推动着这个过程发展的,是孕育在凯恩斯体系中的逻辑矛盾。在狭义均衡的意义上,这个过程迄今已相继经历了先合后分两个阶段。

众所周知,凯恩斯《就业、利息和货币通论》的划时代意义,在于它贯穿的是如果没有“拍卖人”,价格就不可能任何时候都使一切市场都出清的基本思想,采用的是不仅把价格,而且把数量也作为调整变量的基本方法,得出的是“就业不足均衡”应该看作市场经济条件下通例的基本结论。当古典学派面对大萧条

一愁莫展的时候,《通论》所提示的关于失业的令人信服的解释和对策,不仅奠定了凯恩斯作为宏观经济学一代宗师的地位,而且也确立了他作为非瓦尔拉斯经济理论开创者的地位。

然而,令人遗憾的是,凯恩斯并没有能够为自己的理论准备好相应的微观经济学基础,而科学的经济理论却总需要能把对于经济现象的解释合乎逻辑地归结为基本决策单位的行为。另一方面,同马歇尔、瓦尔拉斯的名字联系在一起的传统微观经济学,又无法直接用于处理诸如失业这样的各种宏观经济论题。因此,如何使宏微观经济学融成一体,便成了凯恩斯勋爵后两代经济学家悉心探究的一个主要课题。

最先对这个问题给予回答的,是以希克斯、萨缪尔森、莫迪利安尼等为代表的新古典综合理论。它以凯恩斯理论说明短期波动,以瓦尔拉斯理论说明长期均衡,用折中的办法将两者凑合到一起。在长达30来年的时间里,这种理论一直被看作标准的凯恩斯主义范式,给人以宏微观经济学似乎已经双剑合璧的满足。但是,作为凯恩斯数量调整分析关键的消费函数概念,同瓦尔拉斯的一般均衡理论实际上是不相容的。前者把收入视为既定,后者则认为行为人可以通过要素销售量的决定而对收入加以

选择。因此,自 20 世纪 60 年代以来,这种貌似统一的局面就被沿两个不同研究方向前进的新的探索过程所代替。

一个方向由新古典学派代表。他们把市场出清的瓦尔拉斯均衡理论和方法作为统一宏微观经济学的基础和分析各种宏观经济问题的一般方法。在他们看来,非自愿失业并不存在,波动是个人根据预期作跨时期选择的结果。凯恩斯模型不能解决通货膨胀和供给冲击问题,所以不应该充当宏观经济分析的一般框架。同时,它也不应该作为宏观经济分析的开端,因为,它必须以市场失灵作为前提,不参照市场均衡,就不能充分把握它的特征。

另一个方向由非均衡学派代表。他们从凯恩斯的基本思想出发,在市场不出清假设下建立一系列非瓦尔拉斯的微观经济原理,然后,又以适当的方式在这些原理之上构筑起非瓦尔拉斯宏观经济框架,统一处理各种传统的宏观经济论题。在他们看来,新古典方法和只考虑超额供给的传统凯恩斯方法都可以作为子区域综合在这个框架之中。

本书是后一个方向上的一部代表性著作,它系统地概括和阐述了非瓦尔拉斯理论在微观经济学和宏观经济学方面几乎所有的最新进展。

(二)

经阿罗、德布鲁严密表述的瓦尔拉斯一般均衡理论,是刻画传统微观经济学的最精致的理论。对待它们,非瓦尔拉斯学派不是一味否定,而是认真做了一番加工改造的扬弃工作:在更为一般的假设下,创造出融前者于自身之中的更为一般的非瓦尔拉斯均衡方法和更为一般的非瓦尔拉斯均衡概念。

非瓦尔拉斯学派认为,瓦尔拉斯理论有两个根本缺陷。第一,它把价格变动使所有市场都出清的假设作为全部理论赖以展示的逻辑前提,而这个假设实际上并不具有普遍的真实性,确切地说,它只能代表现实市场中极小的一个部分。第二,在瓦尔拉斯均衡分析中,行为人只能接受和利用由市场决定的价格信号,对购买和销售的数量作出选择,而不能接受和利用由市场决定的数量信号,作出理性的价格决定。为克服这两个缺陷,建立一个能描述不能自动出清时分散化经济运行状况的统一的理论模型,非瓦尔拉斯分析从一开始就放弃了市场出清假设。由此引出的结果既广泛又深刻,特别表现在这样几个方面:

第一,市场通行的价格不必等于它的市

场出清值。市场实现的交易与市场的供给和需求不同时、不完全相等。各市场精确的交易水平,由该市场特有的配额方案,以出现在该市场中的所有行为人的需求函数和供给函数的形式决定。在交易过程中,市场上形成的数量信号的性质随配额方案的特定类别而变化。

第二,行为人向市场发送的,已不再是只作为价格信号函数的观念需求和观念供给信号,而是同时作为价格信号和数量信号函数的有效需求和有效供给信号。数量信号的引入导致了传统选择理论的重铸。一个市场的有效需求和有效供给是使行为人在受其他市场上遇到或预期到的约束的限制下实现目标函数最大化的交易。它们视数量约束是否确定,以及行为人是否决定价格而采取各种不同的形式。

第三,行为人可以制定价格,并以此修正他们所面临的数量约束。刻画价格制定者(买者或卖者)决定的价格同预期数量约束(其他行为人的总供给和总需求)的关系的供求曲线,作为求解最优价格的重要限制条件,充分体现了数量约束在非瓦尔拉斯均衡形成中的作用。

第四,对于未来时期的预期的形成,不仅利用了价格信号,而且利用了数量信号,

将作为过去(可以假设为既定的)和现期价格—数量信号的函数的预期嵌入目标函数,就可以说明预期对于现期存量决策的影响,展开对动态多时期问题的研究。预期因素会强化溢出效应,因为它像现期约束一样影响有效需求。

从没有拍卖人市场就不会自动出清这个假定出发,非瓦尔拉斯理论在保留和运用瓦尔拉斯理论中一般均衡和最优化分析等行之有效的的方法的基础之上,对传统的交易、供求、价格和预期形成诸理论进行了全面的修正和多方面的扩充,从而创造出了一系列适合于在供求不平衡和价格、数量混合调整这种更为一般的情况下描述单个市场和整个经济运行的非瓦尔拉斯均衡概念。

作为瓦尔拉斯均衡概念的扩展和一般化,各种非瓦尔拉斯均衡概念(又称配额均衡或 K 均衡)具有这样三个主要特征:(1)引入价格刚性;(2)引入数量信号和数量调节;(3)即使价格有伸缩性,也不一定就能调整得使所有市场都供求相等。瓦尔拉斯均衡概念被认为只适用于所有市场同时出清的特殊情况,非瓦尔拉斯均衡概念却适合于范围从完全刚性,经过垄断竞争到充分伸缩性的多种价格形成制度。实际上,固定价格和完全伸缩价格均衡不过是有界浮动价格均衡中,价