

## 第六版中文版序

有机会为拙著《微观经济理论》第六版的中文版撰写前言,我深感愉快。从1971年本书初次印行以来,在每一次再版的时候,我都要通过加入新的材料,引入当时新发展起来的最新微观经济学理论来尽量改进它。现在,我可以对我的工作有多么成功进行一次很好的检验,看看这本教材对中国学生是否有用,以及能提供多大的帮助。我希望你们也进行这样的检验。现在,整个世界也许没有一个地方的经济会比中国经济更有意思了。许多人相信,如果你能真正理解市场的作用,市场将会产生巨大的有益于人类的力量。我希望本书能对中国应如何前进的讨论有一些贡献,哪怕这种贡献是十分微小的。当然,我知道,本书对你们的需要而言还不是十分完美的,因为它主要是从西方的角度写就的。我也担心对未来中国经济增长非常重要的一些题目(例如技术变革或不完全市场的研究)在书中阐述得不够充分,书中提供的有关的经济学文献亦不够完整。然而,我希望本书能够为你们提供一个开端,鼓励你们更努力地学习,可能的话,为我已发现的这一总在变化、永远神奇的领域作出贡献。

我将乐于从你那里听到你从书中找到错误的任何消息,我也乐于听到可以改进我的表述的任何建议。通过电子邮件我们很容易联系,我的 e-mail 地址为 [wenicholson@amherst.edu](mailto:wenicholson@amherst.edu)。


瓦尔特·尼科尔森  
于麻省阿姆哈斯特市  
1998年7月

## **PREFACE TO THE SIXTH EDITION CHINESE EDITION**

It is a great pleasure for me to be able to prepare this preface to the Chinese language edition of my *Microeconomic Theory*, 6th Edition. From the time that this book was first published in 1971 I have tried to improve it with each edition by incorporating new material that provides students with an introduction to modern microeconomics as it is currently practiced. Now I will have a good test of how successful I have been by seeing whether you Chinese students find the text useful and helpful. I hope you will. There is probably no more interesting economy on earth these days than the Chinese economy. As someone who believes that markets provide powerful forces for good if they are well - understood, I hope that my book may contribute, however slightly, to the debate in China about how to proceed. Of course, I recognize that the book may not be perfect for your purposes since it is written mainly from a western perspective. And I worry that some topics that may be very important for future Chinese economic growth (such as technical change or the study of incomplete markets) are not very well covered here nor in the economics literature generally. But I hope this book will provide a start that will encourage you to learn more and, perhaps, contribute to what I have found to be an everchanging and always fascinating field.

I would be happy to hear from any of you who find errors in the book or have any suggestions on how my presentation might be improved. I can best be reached through e-mail ([wenicholson@amherst.edu](mailto:wenicholson@amherst.edu)) - feel free to send me a note.

Walter Nicholson  
Amherst, Massachusetts  
July, 1998



就如《微观经济理论：基本原理与扩展》的以前各版一样，本书第六版的目标仍是向学生提供一部全面、易懂、能达到微观经济学理论发展前沿的教科书。为此，在书中对主要的结论提出了更直观的解释，对许多经济学问题（如最大化问题与均衡问题）给出了结构统一的数学表达。第六版还有一个很具体的目的，就是向那些希望自己能从事一些经济学题目研究的同学，提供了书中提及的理论产生的年代及所具有的特征。

### 第六版的变化

第六版教材内容的主要变化如下：

◇主要对有关不确定性和信息的一些章节做了修订，以便能够提供一个统一的理论框架来考察在风险厌恶情况下的最优化行为。

◇新增了一章，其内容为竞争模型的应用，它说明了在各种不同的理论分析与研究中如何对福利进行计算。

◇对价格歧视的讨论进行了修订与较大的扩展，对这一题目正在迅速增多的文献做了介绍。

◇重写了公共选择这一章，加进了一些关于代议制政府投票模型和关于寻租行为的新材料。

除了以上这些实质性的变化外，第六版还有一些具有辅助性的形式与特点方面的变化，这些变化主要有：

◇以前出现在每一章结尾的“应用”，现在被重新整理，分别放入“实证研究指南”之中。理论应用是要说明微观经济学模型应如何估计，并对获得的一些结论进行了概括。

◇在有些章后，增加了一些额外的“扩展”内容，它可以帮助学生

阅读更深入的文献。这方面新增的题目包括特殊偏好的建模、风险的定价、搜寻的经济学与最优价格表。

◇书中还提出了许多新问题,通过讨论,也产生了一些新的理论结论。

◇由 Tod Porter 与 Teresa Riley 提供的新式计算机辅助设备,使我们可以运用记录表和图形更直观地加强本书的数学结论。

◇全面修订了由 David Stapleton 编写的学生用书。

◇在习题答案手册中增补了新的题库。

由于所有这些变化的主要目的是为了确保本教材对学生来说是新颖和有用的,所以,我将非常欢迎批评指正。

在修订本书时,我得到了下列学者(名单略)的大力帮助,使用本书的许多人也对本书各部分应如何改进善意地提出了他们的想法,他们还指出了书中的一些错误,并就我对书中一些问题的理解与我进行了讨论。我非常欣赏这些帮助,希望在今后能听到更多的意见。在最近几年,通过电子邮件所得到的信息对我特别有帮助,用下列地址: WENICHOLSON@AMHERST.EDU 与我联系,我总能收到,除了特别荒谬的内容外,我会对所有的来函作出答复。

在过去的一些年中,阿姆哈斯特学院的学生成了本书新内容的实验品,对于他们提出的许多卓见(与抱怨)我还没有很好地感谢他们。他们中的六位(名单略)对我帮助最大,对此请接受我的衷心感谢。

我还要指出,我非常幸运地得到了哈皮·克瑞莫的帮助,他仔细阅读了全书,对书中许多难以处理的地方进行了很好的安排,由于他的工作,书中的数学部分比我写出的状况有了很大的改善。Dryden 出版社的工作人员为保证准时出书进行了通常的很专业的工作(具体情况略)。最后,我要感谢我的家人苏珊、凯特、戴维、托瑞和保罗。

瓦尔特·尼科尔森  
于麻省阿姆哈斯特市  
1994年9月

# 《常青藤——经济学读本选译》

陈振汉 杨纪琬 崔书香  
胡代光 谭崇台 王传纶  
孙维炎 李子奈

范家骧

韩天雨

张抒文 王小明

张抒文

毛增余



第六版中文版中文序 .....	( I )
第六版中文版英文序 .....	( II )
著者序 .....	( III )

## 第一编 引言

<b>第一章 经济模型</b> .....	( 3 )
§ 1 理论模型 .....	( 3 )
§ 2 经济模型的验证 .....	( 4 )
§ 3 经济模型的一般特征 .....	( 5 )
§ 4 经济价值论的发展 .....	( 7 )
§ 5 最近的发展与本书的方法 .....	( 16 )
小结 .....	( 18 )
<b>第二章 最优化的数学表达</b> .....	( 23 )
§ 1 一个变量函数的最大化 .....	( 23 )
§ 2 多变量函数 .....	( 28 )
§ 3 多个变量函数的最大化 .....	( 31 )
§ 4 隐函数 .....	( 33 )
§ 5 包络定理 .....	( 35 )
§ 6 具有约束条件的最大化 .....	( 39 )
§ 7 约束条件下的最大化问题中的包络定理 .....	( 45 )
§ 8 无法计算的最大化问题 .....	( 46 )
小结 .....	( 47 )
附录:二阶条件 .....	( 54 )

§ 1 具有单一独立变量的函数 .....	(54)
§ 2 具有两个独立变量的函数 .....	(55)
§ 3 线性约束下的两个独立变量的函数 .....	(57)

## 第二编 选择与需求

<b>第三章 偏好与效用</b> .....	(65)
§ 1 理性选择定理 .....	(65)
§ 2 效用 .....	(66)
§ 3 交易与替代 .....	(69)
§ 4 一个可供选择的推导: 边际效用 .....	(77)
§ 5 效用函数举例 .....	(79)
小结 .....	(84)
扩展: 特别的偏好 .....	(87)
<b>第四章 效用最大化与选择</b> .....	(93)
§ 1 一个初始的概括 .....	(94)
§ 2 两种商品的情况: 图形分析 .....	(95)
§ 3 $n$ 种商品的情况 .....	(99)
§ 4 间接效用函数 .....	(105)
§ 5 对偶与效用最大化问题 .....	(107)
小结 .....	(110)
扩展: 效用函数与预算份额 .....	(114)
<b>第五章 收入或商品价格变化的效应</b> .....	(119)
§ 1 需求函数 .....	(119)
§ 2 收入变化 .....	(121)
§ 3 一种商品价格的改变 .....	(124)
§ 4 消费者的需求曲线 .....	(129)
§ 5 补偿性需求曲线 .....	(132)
§ 6 对价格变化反应的数学进展 .....	(135)
§ 7 显示性偏好与替代效应 .....	(138)
§ 8 消费者剩余 .....	(141)
小结 .....	(145)
扩展: 谢泼德引理与罗伊恒等式 .....	(148)
<b>第六章 商品间的需求关系</b> .....	(153)
§ 1 两种商品的情形 .....	(153)
§ 2 替代品与互补品 .....	(155)

§ 3 净替代品与净互补品 .....	(158)
§ 4 组合商品 .....	(159)
§ 5 商品的家庭生产特征与内含的价格 .....	(162)
小结 .....	(167)
扩展:独立的效用 .....	(170)
<b>第七章 市场需求与弹性 .....</b>	<b>(175)</b>
§ 1 市场需求曲线 .....	(175)
§ 2 弹性 .....	(180)
§ 3 弹性之间的关系 .....	(183)
§ 4 需求曲线的类型 .....	(187)
§ 5 弹性的实证估计 .....	(191)
小结 .....	(195)
扩展:汇总 .....	(199)

### 第三编:选择理论的补充应用

<b>第八章 交换 .....</b>	<b>(205)</b>
§ 1 从自愿交易中获益 .....	(205)
§ 2 埃奇沃思盒形图 .....	(207)
§ 3 初始禀赋的交换与交易所得的分配 .....	(213)
§ 4 可行的交易与交换经济的核心 .....	(215)
§ 5 均衡价格下有效率的交易 .....	(217)
小结 .....	(220)
<b>第九章 不确定条件下的选择:预期效用与风险厌恶 .....</b>	<b>(227)</b>
§ 1 概率与期望值 .....	(227)
§ 2 公平博弈与预期效用假说 .....	(229)
§ 3 冯纽曼—摩根斯坦定理 .....	(230)
§ 4 风险厌恶 .....	(232)
§ 5 对风险厌恶的测度 .....	(235)
§ 6 不确定性情况下进行选择的状态偏好法 .....	(239)
小结 .....	(245)
扩展:均值—方差分析与风险定价 .....	(248)
<b>第十章 信息经济学 .....</b>	<b>(257)</b>
§ 1 信息的性质 .....	(257)
§ 2 信息的价值 .....	(258)



§ 3 信息与保险 .....	(261)
§ 4 道德风险 .....	(261)
§ 5 逆向选择 .....	(265)
小结 .....	(271)
扩展:搜寻的经济学 .....	(274)

## 第四编 生产与供给

<b>第十一章 生产函数</b> .....	(283)
§ 1 一种投入的变化 .....	(283)
§ 2 等产量图与技术替代率 .....	(286)
§ 3 规模报酬 .....	(290)
§ 4 替代弹性 .....	(293)
§ 5 一些普通的生产函数 .....	(295)
§ 6 技术进步 .....	(299)
小结 .....	(303)
扩展:多要素投入的生产函数 .....	(306)
<b>第十二章 生产成本</b> .....	(313)
§ 1 成本定义 .....	(313)
§ 2 成本最小化的投入选择 .....	(316)
§ 3 成本函数 .....	(321)
§ 4 投入价格的变化 .....	(325)
§ 5 短期与长期的区别 .....	(330)
小结 .....	(342)
扩展:投入的替代性 .....	(345)
<b>第十三章 利润最大化与供给</b> .....	(351)
§ 1 厂商的性质与行为 .....	(351)
§ 2 利润最大化 .....	(352)
§ 3 边际收益 .....	(354)
§ 4 作为价格接受者的厂商的短期供给 .....	(359)
§ 5 利润最大化与要素投入需求 .....	(362)
§ 6 短期的生产者剩余 .....	(365)
小结 .....	(367)
扩展:利润函数 .....	(371)
<b>第十四章 厂商的其他模型</b> .....	(375)
§ 1 收益最大化 .....	(375)

§ 2 厂商内部的契约 .....	(378)
§ 3 厂商的组织 .....	(378)
§ 4 与工人的契约 .....	(381)
§ 5 与管理者的契约 .....	(387)
§ 6 非盈利组织 .....	(392)
小结 .....	(393)

## 第五编 完全竞争

<b>第十五章 竞争性价格决定的局部均衡模型</b> .....	(403)
§ 1 供给反应的时间 .....	(403)
§ 2 极短期定价 .....	(403)
§ 3 短期的价格决定 .....	(405)
§ 4 供给曲线与需求曲线的移动:图形分析 .....	(410)
§ 5 供给与需求的数学模型 .....	(414)
§ 6 长期分析 .....	(416)
§ 7 长期均衡:成本不变的情况 .....	(417)
§ 8 长期供给曲线的形状 .....	(420)
§ 9 长期供给弹性 .....	(423)
§ 10 长期均衡的比较静态分析 .....	(424)
§ 11 长期生产者剩余 .....	(427)
小结 .....	(430)
<b>第十六章 应用竞争分析</b> .....	(437)
§ 1 经济效率与福利分析 .....	(437)
§ 2 价格控制与短缺 .....	(440)
§ 3 税收负担分析 .....	(442)
§ 4 贸易限制 .....	(446)
小结 .....	(450)
<b>第十七章 一般竞争均衡</b> .....	(457)
§ 1 一般均衡模型 .....	(457)
§ 2 完全竞争的价格体系 .....	(458)
§ 3 一般均衡的说明 .....	(459)
§ 4 关于一般均衡的简单图形模型 .....	(460)
§ 5 比较静态分析 .....	(470)
§ 6 一般均衡建模 .....	(472)
§ 7 一般均衡价格的存在 .....	(474)

§ 8 一般均衡模型中的货币 .....	(481)
小结 .....	(485)
扩展:一般均衡概念的一般化 .....	(489)
<b>第十八章 完全竞争的有效性</b> .....	(495)
§ 1 斯密的看不见的手的假设 .....	(495)
§ 2 帕累托有效性 .....	(495)
§ 3 生产有效性 .....	(496)
§ 4 混合生产的有效性 .....	(502)
§ 5 竞争性价格与有效性 .....	(505)
§ 6 偏离竞争假设的效应 .....	(508)
§ 7 次优理论 .....	(512)
小结 .....	(514)
附录 线性规划、投入要素的定价与对偶 .....	(520)
<b>第十九章 信息、市场调节与竞争均衡</b> .....	(529)
§ 1 建立竞争均衡价格 .....	(529)
§ 2 非均衡价格与预期 .....	(534)
§ 3 信息与帕累托有效性 .....	(538)
小结 .....	(541)

## 第六编 不完全竞争模型

<b>第二十章 垄断市场模型</b> .....	(549)
§ 1 进入障碍 .....	(549)
§ 2 利润最大化与产出选择 .....	(551)
§ 3 垄断与资源配置 .....	(555)
§ 4 垄断与产品质量 .....	(558)
§ 5 价格歧视 .....	(560)
§ 6 歧视价格计划 .....	(564)
§ 7 垄断管制 .....	(566)
§ 8 垄断的动态观点 .....	(569)
小结 .....	(570)
扩展:最优价格计划 .....	(573)
<b>第二十一章 不完全竞争市场的定价理论</b> .....	(581)
§ 1 同质寡头下的定价 .....	(581)
§ 2 产品差别 .....	(590)
§ 3 广告与信息 .....	(594)

§ 4 进入 .....	(595)
小结 .....	(600)
扩展:垄断竞争 .....	(603)
<b>第二十二章 策略与对策论 .....</b>	<b>(609)</b>
§ 1 基本概念 .....	(609)
§ 2 对策论的均衡概念 .....	(610)
§ 3 以广告对策为例证 .....	(611)
§ 4 囚犯两难问题 .....	(614)
§ 5 两时期的广告对策 .....	(617)
§ 6 定价行为模型 .....	(619)
§ 7 进入、退出与策略 .....	(623)
§ 8 $n$ 个局中人的对策论 .....	(627)
小结 .....	(629)
扩展:策略替代与互补 .....	(632)

## 第七编 要素市场定价

<b>第二十三章 厂商对生产要素的需求 .....</b>	<b>(641)</b>
§ 1 利润最大化与派生需求 .....	(641)
§ 2 投入需求的比较静态分析 .....	(644)
§ 3 数学推导 .....	(647)
§ 4 投入需求对投入定价变化的反应 .....	(649)
§ 5 边际生产力分析与要素份额的决定 .....	(652)
§ 6 要素投入市场的买方独家垄断 .....	(654)
§ 7 投入供给中的垄断 .....	(657)
小结 .....	(658)
扩展:劳动的需求弹性 .....	(663)
<b>第二十四章 劳动供给 .....</b>	<b>(669)</b>
§ 1 时间的配置 .....	(669)
§ 2 劳动供给的数学分析 .....	(672)
§ 3 个人的劳动供给曲线 .....	(676)
§ 4 市场的劳动供给曲线 .....	(677)
§ 5 时间配置模型的其他应用 .....	(678)
§ 6 职业选择与补偿性工资差别 .....	(679)
§ 7 工会 .....	(681)
小结 .....	(684)

<b>第二十五章 资本</b> .....	(689)
§ 1 资本与回报率 .....	(689)
§ 2 回报率的定义 .....	(691)
§ 3 厂商对资本的需求 .....	(696)
§ 4 折现值标准 .....	(699)
小结 .....	(704)
附录 A:关于复利的数学 .....	(709)
§ 1 折现值 .....	(709)
§ 2 连续时间 .....	(711)
附录 B:控制论与跨时期的最优资源配置 .....	(713)
§ 1 数学模型 .....	(713)
§ 2 可耗竭资源的使用 .....	(715)

## 第八编 市场的限度


<b>第二十六章 外部性与公共品</b> .....	(723)
§ 1 外部性的定义 .....	(723)
§ 2 外部性与配置效率 .....	(725)
§ 3 处理外部性问题的传统方法 .....	(727)
§ 4 产权、配置与科斯定理 .....	(730)
§ 5 公共品的特征 .....	(732)
§ 6 公共品的有效供应 .....	(734)
§ 7 公共品的林达尔定价 .....	(738)
§ 8 揭示公共品的需求:搭便车问题 .....	(740)
小结 .....	(741)
<b>第二十七章 公共选择理论</b> .....	(749)
§ 1 社会福利标准 .....	(749)
§ 2 社会福利函数 .....	(752)
§ 3 阿罗不可能性定理 .....	(754)
§ 4 直接投票与资源配置 .....	(756)
§ 5 代议制政府 .....	(760)
§ 6 寻租 .....	(762)
小结 .....	(763)
“请回答”的答案简述 .....	(769)
奇序号练习题的答案 .....	(781)

---

常用词汇表 .....	(799)
附录一:著作者姓名中英文对照表 .....	(809)
附录二:关键词中英文对照表 .....	(815)
<b>译后记</b> .....	<b>(827)</b>

# 第一编

## 引 言



第一编有两章内容,它们是微观经济理论的研究基础。第一章描述了微观经济学中使用的一般方法,特别指出了经济学家是如何设计说明经济行为的简单模型并加以验证的;给出了用简化的理论模型考察复杂过程(如放射性物质中原子的相互作用或者我们所关心的现代经济运行)所涉及的所有科学理论。在这一章中,还将讨论与构建经济模型和“好”模型如何可能不同于“坏”模型的分析有关的一些哲学问题。

第二章提供了数学基础。它描述了用来解决最大化问题与最小化问题的几个方法。因为许多经济模型假设经济人(个人、厂商、政府机构,等等)在资源有限的条件下,追求某些值的最大化,本书的主要讨论都集中在这样的问题上。这一章介绍的数学技术在以后的章节中会反复应用,以推导出有关经济行为的含义。本章的附录进一步提供了运用二阶条件的数学分析,以确保经济人的选择真正是可行的最佳选择。





# 第一章 经济模型

经济学的传统定义是研究稀缺资源是如何在竞争性的最终用途之间配置的。这个定义强调了在书中我们始终关心的经济学的两个重要特点。第一,生产性资源是稀缺的,难以充分满足人类的所有需要。这一稀缺性对社会可获得的选择与社会成员所拥有的机会都加上了各种约束条件:个人的花费不能超过其收入,一天的时间不能超出 24 小时。此外还得作出如何使用这些资源的选择。作出选择的必要性导出经济学定义的第二个特点:这些选择究竟具体是怎样作出的。通过考察消费者、生产者、资源供应者、政府和选民的行为,经济学家试图弄清资源是如何配置的。说明经济学家如何通过运用一些工具来解决这个问题是本书的目的。

在这一章,我们将对这些内容作一介绍。首先,我们要讨论理论模型在科学研究中的作用,我们特别关注在经济学中运用这些模型的方式,随后,我们将考察经济模型是怎样被现实世界的信息所证明的。再次,作为经济模型扩展的一个理论实例,我们将回顾我们所熟悉的供求决定价格模型的发展历史。这一讨论将提供对初级经济学教程所含素材的一个粗略的评论,在评论中将运用一些简单的数学对素材作一简单归纳。

## § 1 理论模型

现代经济学是一个很复杂的领域。成千上万的厂商从事着千百万种商品的生产,千百万人从事着各种职业,并各自决定着购买哪些商品。在一定程度上所有这些行为都是相关联的。以花生为例,适时收获花生,并且用船运到加工厂制成花生酱、花生油、脆花生和许多其他的花生美味。显然,这些加工厂确信它们的商品适量运到成千上万的零售点,可以满足消费者的需求。

因为要描述经济中所有细节的特征是不可能的,所以经济学家的办法是对十分复杂的现实世界进行抽象,以建立能抓住其“本质”的很简单的模型。正如街道图是有帮助的,即便它没有标明每一栋住宅或每一片草地,花生市场的经济模型也很有用,尽管它没有记录下花生经济的细小特征。在本书中,我们将对那些得到最广泛应用的经济模型进行较深入的研究。我们将看到,即便这些模型是复杂的现实世界的真实抽象,它们还是不能抓住所有经济行为共有的某些特