

当代世界学术名著·经济学系列

ECONOMICS AND CONSUMER BEHAVIOR

经济学与消费者行为

安格斯·迪顿

Angus Deaton

[英] 约翰·米尔鲍尔 / 著

John Muellbauer

龚志民 宋 旺

解 烜 向洪金 / 译

龚志民 / 校

中国人民大学出版社

 当代世界学术名著·经济学系列

ECONOMICS AND CONSUMER BEHAVIOR

经济学与消费者行为

安格斯·迪顿
Angus Deaton
[英] 约翰·米尔鲍尔 / 著
John Muellbauer
龚志民 宋 旺
解 烜 向洪金 / 译
龚志民 / 校

 中国人民大学出版社

图书在版编目 (CIP) 数据

经济学与消费者行为 / (英) 迪顿著; 龚志民等译.

北京: 中国人民大学出版社, 2005

(当代世界学术名著·经济学系列)

ISBN 7-300-06792-1

I. 经…

II. ①迪…②龚…

III. 消费者行为论

IV. F713.55

中国版本图书馆 CIP 数据核字 (2005) 第 097910 号

当代世界学术名著·经济学系列

经济学与消费者行为

[英] 安格斯·迪顿 Angus Deaton

[英] 约翰·米尔鲍尔 John Muellbauer / 著

龚志民 宋 旺 / 译

解 烜 向洪金 / 译

龚志民 / 校

出版发行 中国人民大学出版社

社 址 北京中关村大街 31 号

邮政编码 100080

电 话 010-62511242 (总编室)

010-62511239 (出版部)

010-82501766 (邮购部)

010-62514148 (门市部)

010-62515195 (发行公司)

010-62515275 (盗版举报)

网 址 <http://www.crup.com.cn>

<http://www.ttrnet.com> (人大教研网)

经 销 新华书店

印 刷 河北三河市新世纪印务有限公司

开 本 700×1000 毫米 1/16

版 次 2005 年 9 月第 1 版

印 张 32.25 插页 2

印 次 2005 年 9 月第 1 次印刷

字 数 480 000

定 价 39.00 元

版权所有 侵权必究

印装差错 负责调换

“当代世界学术名著” 出版说明

中华民族历来有海纳百川的宽阔胸怀，她在创造灿烂文明的同时，不断吸纳整个人类文明的精华，滋养、壮大和发展自己。当前，全球化使得人类文明之间的相互交流和影响进一步加强，互动效应更为明显。以世界眼光和开放的视野，引介世界各国的优秀哲学社会科学的前沿成果，服务于我国的社会主义现代化建设，服务于我国的科教兴国战略，是新中国出版的优良传统，也是中国当代出版工作者的重要使命。

我社历来注重对国外哲学社会科学成果的译介工作，所出版的“经济科学译丛”、“工商管理经典译丛”等系列译丛受到社会广泛欢迎。这些译丛多侧重于西方经典性教材，本套丛书则旨在选译国外当代学术名著。所谓“当代”，我们一般指近几十年发表的著作；所谓“名著”，是指这些著作在该领域产生巨大影响并被各类文献反复引用，成为研究者的必读著作。这套丛书拟按学科划分为若干个子系列，经过不断的筛选和积累，将成为当代的“汉译世界学术名著丛书”，成为读书人的精神殿堂。

由于所选著作距今时日较短，未经历史的充分洗练，加之判断标准的见仁见智，以及我们选择眼光的局限，这项工作肯定难以尽如人意。我们期待着海内外学界积极参与，并对我们的工作提出宝贵的意见和建议。我们深信，经过学界同仁和出版者的共同努力，这套丛书必将日臻完善。

中国人民大学出版社

2002年6月

“经济学系列”策划人语



经济学到了 20 世纪才真正进入一个群星璀璨的时代。在 20 世纪，经济学第一次有了一个相对完整的体系。这个体系包容了微观经济学和宏观经济学这两个主要的领域。经济学家们在这两个主要的领域不断地深耕密植。使得经济学的分析方法日益精细完美。经济学家们还在微观和宏观这两个主干之上发展出了许多经济学的分支，比如国际经济学、公共财政、劳动经济学等等。体系的确立奠定了经济学的范式，细致的分工带来了专业化的收益。这正是经济学能够以加速度迅猛发展的原因。

走进经济学的神殿，人们不禁生出高山仰止的感慨。年轻的学子顿时会感到英雄气短，在这个美轮美奂的殿堂里做一名工匠，付出自己一生的辛勤努



力，哪怕只是为了完成窗棂上的雕花都是值得的。

然而，21世纪悄然降临。经济学工匠向窗外望去，发现在更高的山冈上，已经矗立起一座更加富丽堂皇的神殿的脚手架。我们的选择在于：是继续在20世纪的经济学殿堂里雕梁画栋，还是到21世纪经济学的工地上添砖加瓦。

斯蒂格利茨教授，这位21世纪的首位诺贝尔经济学奖得主曾经发表过一篇文章，题为《经济学的又一个世纪》。在这篇文章中他谈到，20世纪的经济学患了“精神分裂症”，即微观经济学和宏观经济学的脱节，这种脱节既表现为研究方法上的难以沟通，又反映出二者在意识形态上的分歧和对立。21世纪将是经济学分久必合的时代。一方面，宏观经济学正在寻找微观基础；另一方面，微观经济学也正在试图从微观个体的行为推演出总量上的含义。这背后的意识形态的风气转变也值得我们注意。斯蒂格利茨教授曾经讲到，以下两种主张都无法正确估计市场经济的长期活力：一种是凯恩斯式的认为资本主义正在没落的悲观思想；另一种是里根经济学的社会达尔文主义，表达了对资本主义的盲目乐观。我们已经接近一种处于两者之间的哲学，它将为我们的时代指引方向。

21世纪的经济学将从纸上谈兵转变为研究真实世界中的现象。炉火纯青的分析方法和对现实世界的敏锐感觉将成为经济学的核心所在。

“当代世界学术名著·经济学系列”所翻译的主要是处在20世纪和21世纪之交的经济学著作。这些著作在学术的演进过程中起到的更多是传承的作用。它们是20世纪经济学的集大成者，也是21世纪经济学的开路先锋。这些著作的作者大多有一个共同的特征。他们不仅是当代最优秀的经济学家，而且是最好的导师。他们善于传授知识，善于开拓新的前沿，更善于指引遥远的旷野中的方向。如果不惮“以偏概全”的指责，我们可以大致举出21世纪经济学的若干演进方向：博弈论将几乎全面地改写经济学；宏观经济学将日益动态化；政治经济分析尝试用经济学的逻辑对复杂的政策决策过程有一个清晰的把握；经济学的各个分支将“枝枝相覆盖，叶叶相交通”；平等、道德等伦理学的讨论也将重新进入经济学。

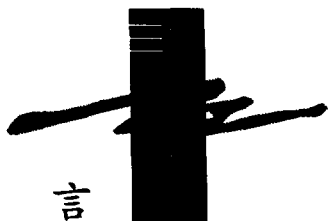
介绍这些著作并不仅仅是为了追踪国外经济学的前沿。追赶者易于蜕变成追随者，盲目的追随易于失去自己的方向。经济学是济世之



学，它必将回归于现实。重大现实问题的研究更有可能做出突破性的创新，坚持终极关怀的学者更有可能成长为一代宗师。中国正在全方位地融入世界经济，中国的国内经济发展也到了关键的阶段。我们推出这套丛书，并不是出于赶超的豪言或是追星的时髦。我们的立足点是，在世纪之交，经济学的发展也正处于一个关键的阶段，这个阶段的思想最为活跃，最为开放。这恰恰契合了中国的当前境况。我们借鉴的不仅仅是别人已经成型的理论，我们想要从中体会的正是这种思想的活跃和开放。

这套丛书的出版是一项长期的工作，中国社会科学院、中国人民大学、北京大学、南京大学、南开大学、复旦大学、中山大学以及留学海外的许多专家、学者参与了这套译丛的推荐、翻译工作，这套译丛的选题是开放式的，我们真诚地欢迎经济学界的专家、学者在关注这套丛书的同时，能给予它更多的支持，把优秀的经济学学术著作推荐给我们。

序 言



本书阐述的是消费者行为的经济理论和它在经济分析中的作用。它是关于效用理论的工具和语言以及它们在包括商品需求的实证分析和社会选择的抽象问题这一领域的应用。基本理论是熟知的，但我们推广了成本函数和相应的“对偶”概念，以使得描述理论的方式能够简化经常被视为困难或不能理解的材料。这一点，以及主题的范围——比任何以前的消费者行为方面的著作更广——是本书最突出的特点。我们写本书的主要目的是提供效用理论的一个完整的工具箱并同时展示这些工具在广泛的经济学前沿的应用中的威力。虽然效用理论的运用是贯穿全书的一条主线，但只有一部分篇幅处理线性约束下的选择这样的标准教科书模型。近些年，通过把消费者理论应用到非标准情形，在经



济学的很多领域都产生了重要的成果。比如把消费者理论应用到离散选择、配给、劳动供给、生育、质量选择，再到由税收和保障系统、流动性限制、不确定性等导致的复杂的非线性预算约束下的选择问题。大部分研究工作强调消费者面对的约束的精细模型的构造，包括统计和计量结果。我们相信这是一个建设性的方法，本书的许多部分都是有关它的讨论。一个新的经济学领域在近些年取得了迅速的进展，它利用消费者理论作为基本的前提。这就是福利经济学的领域，包括指数理论和社会选择。该领域的许多重要进展是基于本书中所讨论的理論的直接应用，我们把这些例子列入效用理论在经济学中的有用性的清单。

本书的设计可满足本科生最后一年（尤其第一部分）和硕士、博士研究生的理论和应用经济学课程教学的要求。它对于对消费者行为有直接或间接兴趣的专业经济学家也应该是有用的。本书的设计使得它在使用上有最大的弹性。第一部分涵盖基本理论及其应用，包括消费函数、耐用品和劳动供给，是一个独立的体系。除了言明的地方，所组织的这些材料是高年级本科生能够理解的，并且对于那些需要需求理论中对偶的直接表述的人来说它可以作为一个完备的入门课程或进修课程。第一部分也是本书其他部分的准备。第二部分主要是对加总和分离性的理论讨论；经济理论的专家（如，在研究生理论课程中）对此将有最大的兴趣，但主要的议题在两章的前面部分有非正式的讨论。第三部分是关于福利经济学；关于指数理论和家庭福利比较的章节是直接的并形成第一部分——用于本科生——的一个自然的扩展。关于社会选择和不公平的章节不可避免地会更加困难，与分离性材料的水平相当。第四部分内容更杂，主要是为研究生设计的。在第一部分的基础上，从第10章到14章能以许多方式与第二部分的和第三部分的单元组合起来。我们也可设想把这里的很多材料，特别是关于劳动供给、消费函数和耐用品的第11章、第12章和第13章以及第一部分的第3章作为应用计量经济学课程的一部分。尽管如此，虽然我们讨论似然函数的表达式并提供实证结果，但我们几乎没有花时间讨论特别的计量经济学议题，这主要是篇幅的原因。

对于本书，除了对微积分，包括偏微分的充分了解，以及对凹的概念和数理统计的基本概念的熟悉以外，不需要其他数学准备。与其他消费理论的教科书不一样，本书除了使用向量和点积的符号以外几

乎没有用到矩阵代数。第1章至第8章,包含的材料一般适合于本科生,其中较难的用(*)或(**)标出;后者即使对于继续学习第四部分的读者来说,在第一次阅读时也可以跳过。我们包含了300多个练习,其目的是完善、加强或推广课文中的材料。那些比邻近更难的习题用星号标示;其中一部分的确十分困难。每章最后有一个进一步阅读的指南,所有提及的工作全部一起列举在书的末尾。

在写作本书的过程中,我们欠了很多人的“债”。知识上的“债务”是最重要的也是最难计量的,但R.斯通和T.戈尔曼两人的影响、他们的工作和例子,对于我们进入这个学科的方式有很大的长期的影响。更特别地,那些阅读深入论题的章节的初稿的同事们的建议和评论对我们是极其重要的。借此机会我们想感谢D.德默瑞、P.哈蒙德、O.哈特、T.杰克逊、R.莱亚德、R.勒坎伯和A.森。作出一一般评论,特别是对于早期一些章节的初稿作出评论的有E.迪沃尔特、A.迪克特、B.法恩,以及已故的M.弗莱明、A.默克斯、J.冯·奥弗哈根和H.锡尔。我们特别感谢G.肯纳利,他阅读了全书并作出评论。一定要提到的还有,Amsterdam大学,Bristol大学和伦敦Birkbeck学院的几组学生忍受了早期的版本;特别地,J.里格尔斯沃斯的意见在修订工作中是最有效的。最后,在排除第一版中存在的一些缺陷的过程中,T.巴顿、M.布朗宁和B.默菲给予了我们帮助。打印是由愉快而不知疲倦的M.哈森和G.贝克完成的,他们的打印快速、准确。最后,我们向赫尔格和凯瑟琳表示最大的感谢,感谢她们在本书写作过程中对我们的宽容。

Bristol 大学 安格斯·迪顿
Brikbeck 学院 约翰·米尔鲍尔

目 录

第一部分 消费者需求分析

第 1 章	选择限制	(3)
1.1	机会集的性质	(4)
1.2	线性预算约束的含义	(14)
第 2 章	偏好与需求	(25)
2.1	公理与效用	(26)
2.2	效用和需求	(32)
2.3	成本最小化与成本函数	(37)
2.4	需求性质	(44)
2.5*	需求对偶理论	(47)
2.6*	显示性偏好理论	(52)



	2.7** 距离函数	(54)
第3章	理论与实践	(61)
	3.1 斯通的分析	(62)
	3.2 线性支出系统	(66)
	3.3 理论检验	(69)
	3.4* 一个新的需求模型	(76)
	3.5 一个评估	(80)
第4章	基本模型的扩展	(89)
	4.1 劳动供给的简单新古典模型	(90)
	4.2 跨期扩展, 消费函数和耐用品	(100)
	4.3 购买和配给约束	(113)

第二部分 可分离性与加总

第5章	对偏好的限制	(123)
	5.1 商品组和可分离性: 一个基本概览	(125)
	5.2* 可分离性和两期预算: 进一步的结果	(131)
	5.3 强分离性和可加性偏好	(142)
	5.4 位似和拟位似	(148)
第6章	市场需求理论	(154)
	6.1 精确的线性加总	(155)
	6.2* 精确的非线性加总	(160)
	6.3 存在外生劳动供给的加总	(166)
	6.4 有条件限制的加总	(169)

第三部分 福利与消费者行为

第7章	消费者价格指数	(177)
	7.1 实际生活成本指数	(178)
	7.2 数量指数和实际消费指数	(188)
	7.3 生活成本分指数	(191)
	7.4 消费者剩余	(193)

第 8 章	家庭特征、家庭需求与家庭福利比较	(200)
8.1	恩格尔的方法	(202)
8.2	恩格尔模型对特定商品的推广	(206)
8.3	实证应用	(212)
8.4	等价尺度的回顾与透视	(215)
第 9 章	社会福利和不公平	(224)
9.1	社会福利函数及其自变量	(225)
9.2	社会福利和不公平	(238)

第四部分 扩展与应用

第 10 章	商品质量与家庭生产理论	(253)
10.1	家庭生产理论	(255)
10.2	家庭生产理论与质量测度的相关性	(264)
10.3	认识质量的另一视角	(271)
10.4	质量的其他方面	(281)
第 11 章	劳动供给	(285)
11.1	参与决定	(286)
11.2	非线性约束和工作时间限制	(293)
11.3	长期劳动供给	(306)
第 12 章	消费函数和跨期选择	(321)
12.1	跨期计划和生命周期	(322)
12.2	收入和消费的动态学	(338)
12.3	信息	(349)
12.4	跨期选择中的一致性	(353)
第 13 章	耐用品需求	(358)
13.1	新古典主义模型	(360)
13.2	存量调整模型和成本调整	(365)
13.3	相机重置模型	(368)
13.4	销售约束和借入约束	(372)
13.5	离散选择、扩散和截面分析	(378)
13.6	习惯和滞后	(385)



第 14 章 不确定条件下的选择	(393)
14.1 不确定性的特征描述	(395)
14.2 不确定条件下的选择公理和 期望值效用最大化	(401)
14.3 一些标准应用：风险规避和 财富配置	(409)
14.4 不确定条件下的跨期消费决策 ...	(420)
14.5 其他应用：搜寻理论	(425)
参考文献	(429)
符号目录	(465)
人名对照	(471)
主题索引	(480)
译后记	(490)

表格与图示索引



表格索引

- 1—1 保险博弈：囚徒 A 和 B
的支付(被判刑
的年数) (13)
- 1—2 四种恩格尔曲线的参数
估计 (20)
- 3—1 斯通食品分析的样本
结果 (64)
- 3—2 斯通的线性支出系统
结果 (68)
- 3—3 对称 Rotterdam 模型：
英国 1900—1970 年 (73)
- 3—4 英国数据 1954—1977 年的
齐次性检验 (80)
- 7—1 通货膨胀在英国 1965—
1976 年的分配效应 (185)
- 8—1 阿姆斯特丹尺度 (203)



8—2	巴顿模型和普雷斯-霍撒克模型应用于有一个年幼小孩的家庭和有一个年龄较大的小孩的家庭时特定商品等价尺度和一般等价尺度	(213)
10—1	对英国旧车市场的享乐回归	(274)
11—1	工作的估计概率	(292)
11—2	就业状况和概率	(304)
13—1	被新车买主替换的旧车年龄	(369)
14—1	支付矩阵	(395)
14—2	彩票	(405)

图示索引

1—1	有生存约束的线性预算限制	(5)
1—2	货物交换经济中的预算约束	(6)
1—3	两段价格的预算约束	(7)
1—4	有转移收入时闲暇和其他商品之间的预算约束	(8)
1—5	有超时奖励工资率和收入税时闲暇和其他商品之间的预算约束	(9)
1—6	有三个被选工作的预算约束	(9)
1—7	“不完善”资本市场下的跨期选择	(10)
1—8	家庭生产产出的预算约束	(11)
1—9	有四种市场商品的食谱问题的预算约束	(11)
1—10	产出依赖于收入分布时两人之间的分配问题	(12)
1—11	有常数弹性的需求函数对总量相符限制的违背	(18)
1—12	模型 (2.17) 中的恩格尔曲线	(19)
1—13	向下倾斜的需求曲线的根据	(21)
2—1	严格凸性偏好	(30)
2—2	凸性但非严格凸性偏好	(30)
2—3	情形 (1)	(32)
2—4	情形 (2)	(33)

2—5	情形 (3)	(33)
2—6	情形 (4)	(33)
2—7	情形 (4) 中的收入效应和替代效应	(35)
2—8	效用最大化和成本最小化	(38)
2—9	成本函数的凹性	(40)
2—10	需求、成本和间接效用函数	(42)
2—11	原始无差异曲线和对偶无差异曲线	(48)
2—12	无差异曲线和非凹成本函数	(49)
2—13	显示性偏好和需求定律	(53)
2—14	距离函数	(55)
2—15	补偿逆需求	(57)
4—1	消费—闲暇选择	(91)
4—2	标准情形和工资变化情形下收入和替代 效应比较	(93)
4—3	向后弯曲的劳动供给曲线	(95)
4—4	跨期消费分配	(103)
4—5	长期和短期成本函数	(115)
4—6	配给 z 的影子价格	(117)
5—1	一棵可能的效用树	(127)
5—2	线性支出系统和一个替代模型的价格弹性 估计	(145)
5—3	位似偏好	(148)
6—1	线性恩格尔曲线	(159)
7—1	基期加权实际和派氏价格指数	(179)
7—2	当期加权实际和派氏价格指数	(180)
7—3	效用的货币度量	(188)
7—4	效用的数量度量	(190)
7—5	马歇尔消费者剩余	(194)
7—6	等价和补偿变化	(196)
8—1	度量等价尺度的恩格尔模型	(204)
8—2	普雷斯-霍撒克模型的无差异曲线	(207)
8—3	普雷斯-霍撒克模型和巴顿模型等价 尺度的变化	(209)