

西方经济与社会科学精品丛书

微观经济学 基础

Einführung in die Mikroökonomik

Peter O. Oberender / Jochen Fleischmann

[德] 彼得·O. 欧伯恩德 / 约翰姆·弗莱希曼 著

蒋璐璐 冯兴元 顾萍 巫佳妮 周方 译

冯兴元 校

中国法制出版社
CHINA LEGAL PUBLISHING HOUSE

微观经济学 基础

Einführung in die Mikroökonomik

Peter O. Oberender/Jochen Fleischmann

[德]彼得·O. 欧伯恩德/约翰姆·弗莱希曼 著

蒋漪漪 冯兴元 顾萍 巫佳妮 周方 译

冯兴元 校

中国法制出版社
CHINA LEGAL PUBLISHING HOUSE

图书在版编目 (CIP) 数据

微观经济学基础/ (德) 欧伯恩德, (德) 弗莱希曼著;
蒋璐璐等译. —北京: 中国法制出版社, 2011. 8

(西方经济与社会科学精品丛书)

ISBN 978 - 7 - 5093 - 2827 - 9

I. ①微… II. ①欧…②弗…③蒋… III. ①微观经济学
IV. ①F016

中国版本图书馆 CIP 数据核字 (2011) 第 077549 号

责任编辑: 袁笋冰

封面设计: 蒋怡

微观经济学基础

WEIGUAN JINGJIXUE JICHU

著者/ (德) 欧伯恩德, (德) 弗莱希曼

译者/ 蒋璐璐等

经销/ 新华书店

印刷/ 三河市紫恒印装有限公司

开本/ 880 × 1230 毫米 32

版次/ 2011 年 9 月第 1 版

印张/ 13 字数/ 225 千

2011 年 9 月第 1 次印刷

中国法制出版社出版

书号 ISBN 978 - 7 - 5093 - 2827 - 9

定价: 42.00 元

北京西单横二条 2 号 邮政编码 100031

传真: 66031119

网址: <http://www.zgfs.com>

编辑部电话: 66066627

市场营销部电话: 66017726

邮购部电话: 66033288

中文版序

微观经济学的研究方法，在企业管理学以及国民经济学的许多局部领域，都有广泛的运用。特别是关于市场关联性的思想，对于理解现代化的、高度复杂的国民经济更是必不可少。只有透析了“市场经济”这个复杂的现象并将它简化到最根本的运作机制，才能理解市场经济秩序中企业行为和政治制度的成功之处并对其进行预测。现代微观经济学为此特别发展出一套高度细化的模式、公式。但这些方法对于很多政治、经济生活中的实践者来说，仍然过于复杂、难以理解，特别是由于其高度、甚至是过度的数学化。

本教科书正是以此为切入点。本书旨在为专业初学者及对此感兴趣的实践者提供一个概括性的、易于理解的微观经济学思想论述，以帮助他们向透析市场现象迈出第一步。出于该目的，本书具备以下特色：

首先要揭示的是市场如何运作。看一下通行的微观经济学标准教材，往往把这一目标置于次要地位，而以观察研究孤立的个别经济行为（例如财政理论、生产理论的局部范畴）开篇。而孤立的、个别的经济行为恰恰不是微观经济学的核心要素！关注的中心当是市场上的个体行为如何相互作用，如何就此产生增进福利的市场结果。与那些教材的内容结构不同，本书首先在第一章即对市场现象进行详尽的阐述。严格意义上的微观经济学，即家庭理论和生产理论，将在之后讨论。这也许会令某些“纯粹主义者”感到不适应，

但却有助于立即理解其根本联系，即人与市场的互动关联性。过度专注于家庭理论、生产理论中的个别演算，常常会忽略这一方面，造成本末倒置。

许多微观经济学教材往往造成一种印象，即经济行为发生在一个完美的“真空”世界里。本书正要避免这种假象。所以即使有时无法详细解释制度理论，也会有意识地援引很多经济行为与现实秩序的相关性。

本书尝试着尽可能少地使用复杂的数学方法。能较好地进行微分计算，便足以理解书中的经济学公式。为了更好地理解微观经济学的本质联系，更是有意识地使用简单的表述，并多配合实例。

本书作者希望，在精确的微观经济学概念与形象的直观表达之间，找到一条中间道路，为初学者及实践者减轻微观经济学入门的难度，使之感受到此套理论的用处。同时，对于程度较高的学生，例如面临阶段性考试的学子，本书也不失为一本高度概括的复习教材。

中文版得以成书，要特别感谢冯兴元教授作出大量联络整合以及校对工作，同时还要感谢本书主要译者以及该中文版的责任编辑。

彼得·O·欧伯恩德 (Peter O. Oberender) 教授、博士

德国拜罗伊特，2011 年 8 月

目 录

中文版序	1
第一章 微观经济学：它是关于什么的学问？	1
一、微观经济学和经济科学 / 2	
二、市场和稀缺 / 6	
（一）近观市场现象 / 6	
（二）稀缺作为出发点 / 8	
（三）经济学是稀缺管理工具 / 11	
（四）经济学在应用上的局限性 / 16	
三、个人的选择情形 / 17	
（一）经济原则 / 17	
（二）机会成本 / 19	
（三）边际原则和稀缺性 / 25	
（四）举例 / 30	
四、实验 / 34	
五、模型思想和微观经济学 / 41	
（一）模型的意义何在 / 41	
（二）建立模型的基础 / 42	
六、展望：微观经济学的组成因素 / 44	

第二章 市场理论基础

49

一、简单的基础模型 / 49

- (一) 模型分析及假设 / 50
- (二) 需求 / 53
- (三) 补充知识：需求的直接价格弹性 / 63
- (四) 供给 / 74
- (五) 价格形成：完全竞争模型 / 75
- (六) 自由价格在国民经济协调过程中的作用 / 81
- (七) 对模型假设的批评 / 90

二、市场形式 I：多头竞争 / 94

- (一) 市场结构对市场协调的意义 / 94
- (二) 多头竞争者的个人经济计划 / 98
- (三) 个人经济计划、行业供给以及市场价格构成 / 115

三、市场形式 II：垄断 / 122

- (一) 引论 / 122
- (二) 垄断形式下的均衡 / 124
- (三) 垄断与竞争的比较 / 135

四、市场形式 III：寡头 / 141

- (一) 引论 / 141
- (二) 价格作为行动参数 / 144
- (三) 行为方式和市场过程 / 153
- (四) 对市场透明度意义的再次论述 / 156
- (五) 市场理论展望 / 157

第三章 市场的相互依赖性

一、派生需求 / 165

(一) 动机 / 165

(二) 作为两类市场纽带的派生需求 / 169

(三) 多头竞争市场中的派生需求 / 173

(四) 垄断市场中的派生需求 / 182

(五) 派生需求与要素报酬原则 / 186

(六) 在垄断情形中的要素报酬原则 / 189

二、技术进步 / 191

(一) 动机 / 191

(二) 技术进步的假设 / 192

(三) 技术进步对就业的作用分析 / 194

第四章 市场、国家与制度

一、动机 / 206

二、处于系统联系之中的市场 / 209

(一) 总体分析、帕累托效率与市场失灵 / 209

(二) 为什么市场需要制度? / 212

三、税收与补贴：国家行为举例 / 220

(一) 税收 / 220

(二) 补贴 / 235

四、国家干预市场经济秩序的问题 / 240

(一) 秩序与过程政策 / 241

(二) 秩序一致性举例 / 243

第五章 家庭理论

249

- 一、导言 / 249
- 二、作为经济学范畴的效用：基数效用还是序数效用理论？ / 255
 - （一）基数效用理论 / 256
 - （二）序数效用理论 / 257
- 三、偏好结构、效用函数和无差异曲线 / 259
- 四、边际替代率 / 267
- 五、家庭预算线 / 271
- 六、最优产品组合（家庭消费最优）的推导 / 274
- 七、戈森定律 / 279
 - （一）戈森第一定律 / 279
 - （二）戈森第二定律 / 281
 - （三）价值悖论 / 283
- 八、模型变动的影响 / 285
 - （一）收入变化分析 / 286
 - （二）价格变化分析 / 289
- 九、需求曲线的推导 / 295
 - （一）个体需求函数 / 296
 - （二）市场需求 / 300
- 十、个人偏好域以及社会过程 / 301
 - （一）从众效应 / 302
 - （二）逆潮效应 / 303
 - （三）凡勃伦效应 / 304

第六章 生产理论	308
一、导言 / 308	
二、成本和生产成本 / 310	
三、单要素的生产函数 / 318	
四、多要素生产 / 326	
(一) 概论 / 326	
(二) 等产量线系和要素变化 / 329	
(三) 要素变化的形式 / 333	
(四) 齐次生产函数 / 342	
(五) 成本函数的推导 / 343	
五、齐次生产函数和多头竞争下的利润情况 / 353	
(一) 基于成本曲线的考虑 / 353	
(二) 分析推导 / 356	
第七章 展望	361
一、行为理论与理性 / 362	
二、作为微观经济学扩展理论的制度经济学 / 367	
三、博弈论 / 372	
(一) 目标定位 / 372	
(二) 囚徒困境与占优对策 / 374	
(三) 市场进入博弈与纳什均衡 / 376	
术语索引	383

第一章 微观经济学：它是关于什么的学问？

假如一位经济系的学生通过最初几个学期逐渐步入错综复杂的经济学体系，那么除了宏观经济学基础教程之外，还有微观经济学基础教程对此无疑是一种良好的帮助。这两个教程传授的是基础模型和方法，它们分别从不同的角度帮助人们思考分析各种经济现象和经济过程（wirtschaftliche Vorgänge），这就对从事经济学分析的观察者提出了很高的抽象能力要求。对经济理论模型（wirtschaftstheoretische Modelle）的研读因此往往给初学者以及对经济学感兴趣的经济学界人士带来很多麻烦。许多人不太明白这些分析方法的意义何在。他们以为微观经济学纯粹是一种与实际毫不相干的学术训练。这方面的原因不仅是与存在大量严肃的假设有关。人们更喜欢接纳的是实用的分析方法和思路。

为矫正这种广泛存在的印象，本引论性章节描述了拓展微观经济学模型（mikroökonomische Modelle）的意义，其说服力何在，以及其分析方法有何用处。模型可以帮助观察者在理论的指导下（也就是以符合事物的严格逻辑的方式），隐去多余的因素来思考实际现象。高度的抽象虽然对认识各种内在关系有裨益，然而往往不利于有关知识直接应用于现实。

微观经济学模型结构如何得以实际应用，可以本引论性章节中包含的一个实例来加以解释，这个实例取自用于拜罗伊特大学经济

系学生第一学期学习的“实验微观经济学教程”。这些实验 (Experimente) 内容旨在既让学生对精选的微观经济学基本概念获得一种直观认识, 也展示这些基本概念的应用可能性。

不过在介绍这些实验之前, 应该先认识微观经济学所关注的核心问题及其引申出的基本分析方法, 由此亦可推演出微观经济学在国民经济学科中的地位, 同时也提示人们留意, 微观经济学思想的应用绝非局限在分析作为经验现象的经济现象, 而是一种可以普遍用来分析人的行为的工具。事实表明, 经济过程是广泛存在于生活中的。正确认识这些经济过程就能找到解读微观经济学的入门途径。本章结束部分包括一个建模方法说明, 并罗列了微观经济学的重要组成部分。

一 微观经济学和经济科学

国民经济学和其他社会学科一样研究的是人的行为, 旨在解释可观察的集合现象 (beobachtbare kollektive Phänomene), 比如市场价格 (实证理论, positive Theorie), 并且予以评价 (规范理论, normative Theorie), 以此告诫人们如何营造人类共同生活 (经济政策)。一般来说, 国民经济理论都被分成微观和宏观经济学这两大领域^①, 然而一种明确的、具有普遍约束力的微观经济学概念的定义及其与宏观经济学的一种明确界分实际是不存在的。对这两门学科只可粗粗地作如下区分: 宏观经济学 (Makroökonomik) 剖析的对象是一些国民经济总量 (volkswirtschaftliche Aggregaten, 比如国民收入和货币供给量), 以及这些宏观总量之间各种联系的规律性。也就是说, 它直接探讨集合

^① 微观和宏观经济学各自包含较为明确规定的专业理论范畴。比如, 宏观经济学的重要篇章就是货币理论、经济周期理论或者增长理论。微观经济学包含的主要范围是市场和竞争理论、效用理论、生产理论, 也包含新近兴起的信息经济学、制度经济学理论。

现象。比如说提出一些命题，包括有关通货膨胀如何依赖于货币供给量的命题，以及有关国民收入和国民消费之间联系的命题。

微观经济学（Mikroökonomik）的分析层次更低一些，它从单个决策者（经济主体）的个体行为出发，以该学科的本原形式分析这些经济主体在市场上的行为。各经济主体各自基于交换关系或者合同关系、以消费者或者生产者的身份在市场上相遇。微观经济学的核心研究对象就是解释在市场条件下消费者和生产者之间的相互作用（Zusammenspiel）结果。其中的结果之一就是市场价格（Marktpreis），它在国民经济协调过程中的角色是微观经济学研究的一个中心对象。因此，过去把微观经济学（甚至包括国民经济学在内）称作为价格理论是习以为常的。不过，现代微观经济学已经大大地超越了它原先的研究范围，它不再局限于以市场行为为主要研究对象，而是将其扩展为一种有关人们行为的普遍理论，由此来解释各种各样的社会现象——在后文中，我们还会述及这方面的内容。

不难想象，微观和宏观经济现象是紧密相关的。一个国民经济其实就是所有市场的总和，而且每一个经济总量也受到国民经济体中各个市场运行结果的决定性的影响。这意味着微观和宏观方法只是从不同的处理方式研究国民经济整体关联的，二者都以各自特有的方式接近现实，因此对各种不同问题的解答具有各自的适用性，二者都对现实复杂性加以简化，而这种复杂性在总体上是不可形象表述的，因此这种简化处理也就会系统性地淡化和忽略某些现实视角而集中观察少数几个关联，也就是建立成模型（Modelle）。微观与宏观经济学的区别因此在于淡化和忽略哪些现实视角，以及从模型理论角度处理哪些关联。

图 1.1 归纳了国民经济在微观和宏观层面上的相互关系。简单地说，宏观经济学关注分析最上层，微观经济学则关注分析中间、最下层面，虽然这种划分在新的经济理论不断形成的情况下愈发显

得过时（比如新的宏观经济模型很大程度上构筑在微观基础之上）。

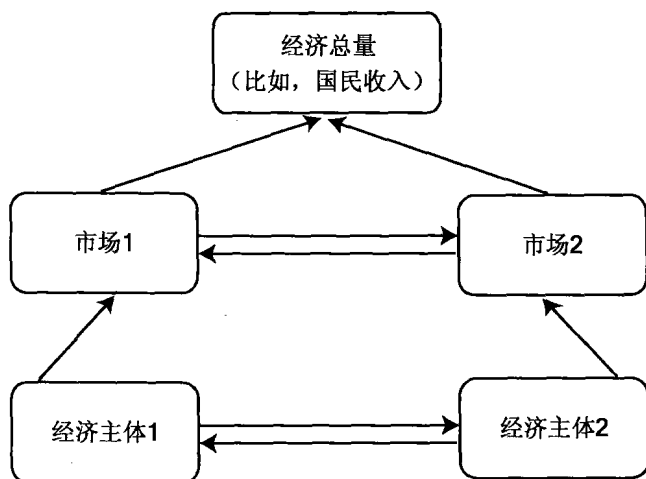


图 1.1 微观和宏观经济学

微观经济学研究和分析两大主题：首先是各个经济主体的行为。在此，微观经济学分析不同角色的人及其行为。在本书中，分析的中心是人们作为消费者（产品的需求者）以及生产者（产品的供给者）的行为，比如分析价格变化对人们消费决策的影响，又如投入多少生产资料（要素组合）产出多少产品。通过分析这些问题可以借助于典型的消费行为模型和企业成本结构得出重要的结论。这些结论是勾画供求曲线的基础。但消费者和生产者行为并非微观经济学研究的所有角色，亦可将他们当做投资者来分析（影响投资决策的因素有哪些，是实物资本还是人力资本），或者当做雇员来分析（雇员在多高工资水平上投入多少工作量）。

在此基础上，我们可以脱离那一被视作纯粹经济领域的生活领域，而将微观经济学应用到其他的生活领域中去。在所谓的“经济学帝国主义”发展过程中，也就派生出了诸如婚姻、家庭、教育、卫生方面的经济理论，围绕的主题是机会成本原则（Opportunitätskostenprinzip），这

将在本篇导论性章节中进一步得到阐述。

微观经济学的第二大研究主题是市场。微观经济学研究的是各经济主体之间如何在发生相互作用，以及在互动中产生的较大的国民经济量值单位与相关结果，特别是市场和行业。它解释消费者和生产者之间交换过程、竞争的作用与结果、市场结构（比如，参与竞争的公司数量、产品种类、技术特性、市场透明度等等）对市场结果（尤其是产品价格与数量）的影响。

在解释市场的同时，微观经济学也对市场结果作出评估。对此需发展一种理想市场参照体系。在这种理想市场上，消费者和生产者的计划得到了最优的相互协调。市场结果被视作有效率的（effizient），或者说是福利最大化的（wohlfahrtsmaximal）。这一理想市场参照系（对此当然尚存争议）显示必须具备何等条件才能创造效率市场并且使之造福于民。如果涉及到政策问题，那么搞清市场的运作方式尤为重要。通过对市场的运作加以解释，可以判断出国家对市场体系的干预究竟产生何等影响，或许其干预如此广泛，以至于真的到了应当加以阻止的程度。对这两大微观经济学研究主题，本导论性章节还将做一概述。

本教材中采用的微观经济学分析方法是有学派归属的。这一学派就是新古典微观经济学（neoklassische Ökonomik）。它产生于19世纪下半叶，其后得到了不断的充实和完善。新古典微观经济学的核心即为边际分析法，借助于它，对追求效用最大化的个人的行为方式的分析有了可操作性。至于这具体意味着什么，本章节还将作进一步阐述。不过得说明，这绝非探讨微观经济论题的唯一可能性，例如古典经济学学派就对市场经济中的价格形成作出解释与分析，当然这完全是建立在截然不同的基础上。英国国民经济学家大卫·李嘉图（David Ricardo，1772—1823）的著作标志着古典经济学在这方面的巅峰之作，但是遭到了新古典学派的排挤。古典经济学思

想的重新崛起得归功于新李嘉图经济学派，不过该学派也只为少数经济学家所推崇，^② 因此本书就不再赘述。

小 结

微观和宏观经济学是分析整体经济现象的不同模型分析法。

微观经济学观察的是人们作为消费者和生产者的行为。

消费者和生产者在市场上的互动关系可以在市场上广泛观察到。

二 市场和稀缺

（一）近观市场现象

交换关系（市场）以及人们在这种交换关系中的行为是微观经济学研究的中心。现实中交换关系和市场是无限存在的。在中东马拉克什市场上商人的讨价还价和纽约股市上的高效组织的股票交易均涉及交换关系，人们大可不必舍近求远去追寻，因为每个人一定都熟识此类日常生活中的交换关系：在面包师那儿买面包、在理发师那里理发、聘请工匠装修（黑市或者正规市场）、网上二手货交易、包括缔结保险或者银行贷款合同，撇开诸如此类典型的市场关系，当今人们各自的生活料理便不可想象。初看这些例举现象好似繁杂无比，找不出头绪来，很难想象晨间买面包和纽约股市会有什么相干。微观经济学为解读这些难题提供的是一种工具，以期从细节中找出其规律性，进而将其框定为一般程式或者理论上的一般规律。这些规律用以解释市场和市场过程是如何运作的，如前所述揭

^② 李嘉图的代表作是1817年出版的《政治经济学及赋税原理》，新李嘉图经济学流派的代表作是皮埃罗·斯拉发（Piero Sraffa）1960年出版的《用产品进行产品生产》。

示市场是一种协调供求的社会引导机制，市场价格在此发挥着中心的引导作用，它发出了有关消费者需要消费哪些产品的信号，从而允许市场参与者根据这些信号调整其行为。

在每个市场上但凡如此，不管是在股票交易市场还是在面包买卖市场。不过这并不是说每个市场都是千篇一律运作的。许多市场具有特性，这些特性要求我们采用不同方式方法来修正这些市场的运作机制。股市就是一例，这种市场具有很严格的规则和操作规程（不是谁都可以进入交易大厅的）。这些规则都是由于股票交易的必要性而从历史上承袭下来的，尤其是出于由一名拍卖员统一定价的必要性。不少市场的正常运作需要特殊的规则，而其他市场无需特殊规则也可正常运作，例如不会有人想到用股市规则来组织早餐面包的买卖（当然并不是说此间无任何条件，为保证市场体系正常运作，一些基础规则总是必须存在的，对此本书尤其是第四章里将作详细论述）。

为了方便研讨各种市场特性，必须首先掌握市场的一般运作模式，即必须首先搞清微观经济学选择的是哪一种基本的观察视角，因为微观经济学不是唯一分析交换关系以及人们的相关行为的科学或者社会科学。以下因素应当为微观经济学的存在提供了理由：与其他学科相比，微观经济学在解释社会的运作方式方面提供了相当不同的认识。

一个刻画微观经济学的特殊贡献的用语就是“稀缺”（Knappheit）。经济学，包括微观经济学在内，都是以人们在交换关系中如何试图缓解这种“稀缺”作为观察视角的。假如不存在这类“稀缺”，经济问题以及经济科学的基础也不复存在。当然这个情景不可想象，而且即使所有产品都应有尽有，消费这些产品的时间仍然会是稀缺的。

以下的数页篇幅将分析稀缺现象及其内涵，从中引申出经济学